

Fecha de Publicación: 2 de noviembre de 2017

Fecha de Información: 31 de octubre de 2017 <sup>1</sup>

## INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Según el reporte de los Intermediarios del Mercado Cambiario durante el día se pactó un total de US\$1871.4 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 3.7%.<sup>2</sup>

**Cuadro No. 1**  
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero**		Intragruppo y Off-shore***		Otros Agentes		Interbancarios
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	232.3	197.6	71.7	96.0	20.1	30.6	105.7
15-35	931.6	762.5	253.5	200.4	109.3	331.4	399.7
36-60	40.6	38.0	0.0	0.6	8.0	10.0	30.0
61-90	11.0	2.2	0.0	0.0	2.2	11.0	0.0
91-180	31.8	47.5	40.0	0.5	7.5	31.3	0.0
>180	106.7	95.1	0.0	0.0	5.1	16.7	90.0
<b>Total</b>	<b>1354.0</b>	<b>1142.8</b>	<b>365.2</b>	<b>297.5</b>	<b>152.2</b>	<b>431.1</b>	<b>625.4</b>

\* Cifras en millones de dólares

\*\*Incluye operaciones interbancarias y operaciones con los otros agentes

\*\*\*Operaciones entre filiales (casas matrices y filiales) y con entidades del exterior.

**Cuadro No. 2**

### Devaluación Implícita Ponderada por monto Anualizada

Rango	Sector Financiero*	Otros Agentes sin intragruppo		Total
	Compras/Ventas	Compras	Ventas	
3-14	7.3 %	3.7 %	3.6 %	4.8 %
15-35	3.4 %	3.8 %	3.5 %	3.6 %
36-60	3.1 %	4.0 %	3.1 %	3.2 %
61-90	-	3.7 %	3.0 %	3.1 %
91-180	-	3.4 %	3.0 %	3.2 %
>180	3.2 %	3.7 %	2.7 %	3.1 %
<b>Total</b>	<b>4.0 %</b>	<b>3.7 %</b>	<b>3.5 %</b>	<b>3.7 %</b>

\*Incluye solo operaciones interbancarias

En el cuadro No. 3 se presentan los vencimientos de forwards para ésta y las próximas dos semanas.

**Cuadro No. 3**  
Vencimientos de Forwards

Sectores	30 de oct. al 3 de noviembre				6 al 10 de noviembre				13 al 17 de noviembre			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	39	97	4930	4368	38	103	3922	4336	101	114	3753	3846
Intragruppo y off-shore***	0	0	1602	1385	0	0	1772	713	0	0	1681	823
Otros	97	39	1120	1898	103	38	1051	1696	114	101	1125	1890
<b>Total</b>	<b>136</b>	<b>136</b>	<b>7652</b>	<b>7652</b>	<b>141</b>	<b>141</b>	<b>6746</b>	<b>6746</b>	<b>216</b>	<b>216</b>	<b>6559</b>	<b>6559</b>

\* Cifras en millones de dólares; No incluye operaciones aceptadas por Cámaras de Riesgo Central de Contraparte.

\*\*Incluye operaciones interbancarias y con otros agentes

\*\*\*Operaciones entre filiales (casas matrices y filiales) y con entidades del exterior.

<sup>1</sup> Datos provisionales.

<sup>2</sup> El monto negociado diario corresponde a las operaciones de compra y venta evitando la doble contabilización de las operaciones interbancarias. Además, la fórmula para la devaluación implícita es: ((Tasa Pactada/Tasa de Contado) <sup>Δ</sup> (360/Plazo)) - 1. Para el cálculo de la devaluación implícita se excluyen las operaciones intragruppo.