

Fecha de Publicación: 7 de noviembre de 2017

Fecha de Información: 02 de noviembre 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\$1846.8 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 3.3%.<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	300.3	242.1	63.5	140.0	56.4	38.1	122.2
15-35	532.0	704.1	388.5	136.0	102.6	183.0	213.0
36-60	130.3	108.6	44.0	2.0	64.7	128.3	0.0
61-90	63.2	18.7	0.0	0.0	18.7	63.2	0.0
91-180	26.1	9.3	0.0	0.0	9.3	26.1	0.0
>180	39.2	8.1	0.0	0.0	8.1	39.2	0.0
<b>Total</b>	<b>1091.0</b>	<b>1090.9</b>	<b>496.0</b>	<b>278.0</b>	<b>259.8</b>	<b>477.9</b>	<b>335.2</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	3.0 %	3.7 %	3.5 %	3.4 %
15-35	2.6 %	3.6 %	3.4 %	3.3 %
36-60	-	3.6 %	3.4 %	3.5 %
61-90	-	3.6 %	3.2 %	3.3 %
91-180	-	3.5 %	3.0 %	3.1 %
>180	-	3.5 %	2.8 %	2.9 %
<b>Total</b>	<b>2.8 %</b>	<b>3.6 %</b>	<b>3.4 %</b>	<b>3.3 %</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**	37	102	5340	4510	40	107	4240	4546	103	110	3972	4037
Intragruppo y off-shore***	0	0	1652	1681	0	0	1840	851	0	0	1741	918
Otros	102	37	1099	1900	107	40	1068	1750	110	103	1216	1974
<b>Total</b>	<b>139</b>	<b>139</b>	<b>8091</b>	<b>8091</b>	<b>148</b>	<b>148</b>	<b>7148</b>	<b>7148</b>	<b>212</b>	<b>212</b>	<b>6929</b>	<b>6929</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) ^ (360/Plazo)) - 1. Para el cálculo de la devaluación implícita se excluyen las operaciones intragruppo.