

Fecha de Publicación: 16 de noviembre de 2017

Fecha de Información: 14 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\$1318.8 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 3.3%.<sup>2</sup>

**Cuadro No. 1**  
**Contratos Forwards Pactados**

Rango	Sector Financiero**		Intragrupa y Off-shore***		Otros Agentes		Interbancarios
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	372.9	416.5	225.0	152.8	71.5	100.2	120.0
15-35	503.4	432.5	229.2	203.9	71.3	167.6	132.0
36-60	14.8	7.1	0.0	0.0	7.1	14.8	0.0
61-90	370.8	114.6	0.0	84.5	114.6	286.3	0.0
91-180	11.6	31.0	0.0	0.0	26.0	6.6	5.0
>180	19.1	8.9	0.0	0.0	8.9	19.1	0.0
<b>Total</b>	<b>1292.6</b>	<b>1010.5</b>	<b>454.2</b>	<b>441.2</b>	<b>299.4</b>	<b>594.5</b>	<b>257.0</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 intragrupo		Total
	Compras/Ventas	Compras	Ventas	
3-14	3.5 %	4.0 %	-	-
15-35	3.4 %	3.5 %	3.3 %	3.4 %
36-60	-	3.7 %	3.0 %	3.2 %
61-90	-	3.2 %	3.0 %	3.1 %
91-180	3.0 %	3.6 %	2.8 %	3.4 %
>180	-	3.3 %	2.8 %	2.9 %
<b>Total</b>	<b>3.4 %</b>	<b>3.6 %</b>	<b>-</b>	<b>-</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	13 al 17 de noviembre				20 al 24 de noviembre				27 de nov. al 1 de diciembre			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
<b>Sector Financiero**</b>	113	125	4655	4669	33	119	3346	3806	16	96	4440	4657
<b>Intragrupa y off-shore***</b>	0	0	2070	1231	0	0	1696	927	0	0	1782	1266
<b>Otros</b>	125	113	1326	2151	119	33	995	1304	95	16	1681	1980
<b>Total</b>	<b>238</b>	<b>238</b>	<b>8051</b>	<b>8051</b>	<b>151</b>	<b>151</b>	<b>6036</b>	<b>6036</b>	<b>112</b>	<b>112</b>	<b>7903</b>	<b>7903</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 intragrupo.