

**Fecha de Publicación: 18 de octubre de 2017**

**Fecha de Información: 13 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\$1810.9 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 4.6%.<sup>2</sup>

**Cuadro No. 1  
Contratos Forwards Pactados**

Rango	Sector Financiero**		Intragrupo y Off-shore***		Otros Agentes		Interbancarios
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	381.0	430.1	83.0	36.5	36.1	33.5	311.0
15-35	687.3	572.8	117.5	178.3	182.3	236.1	273.0
36-60	21.5	23.1	0.0	15.0	23.1	6.5	0.0
61-90	2.4	23.7	1.5	0.0	22.2	2.4	0.0
91-180	53.7	41.7	0.0	40.0	31.7	3.7	10.0
>180	81.2	126.3	50.0	40.0	36.3	1.2	40.0
<b>Total</b>	<b>1227.1</b>	<b>1217.7</b>	<b>252.0</b>	<b>309.8</b>	<b>331.7</b>	<b>283.4</b>	<b>634.0</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	
3-14	5.7 %	4.9 %	4.1 %	5.3 %
15-35	4.3 %	4.6 %	4.4 %	4.4 %
36-60	-	4.8 %	4.5 %	4.7 %
61-90	-	4.5 %	8.0 %	4.8 %
91-180	4.1 %	4.5 %	4.1 %	4.3 %
>180	3.7 %	3.6 %	3.5 %	3.6 %
<b>Total</b>	<b>4.9 %</b>	<b>4.5 %</b>	<b>4.3 %</b>	<b>4.6 %</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	9 al 13 de octubre				16 al 20 de octubre				23 al 27 de octubre			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	17	138	5475	5072	22	161	3624	3646	14	136	4597	4374
Intragrupo y off-shore***	0	0	2050	1740	0	0	1483	1001	0	0	2006	1352
Otros	138	17	1175	1888	161	22	1019	1479	136	14	913	1791
<b>Total</b>	<b>155</b>	<b>155</b>	<b>8700</b>	<b>8700</b>	<b>183</b>	<b>183</b>	<b>6126</b>	<b>6126</b>	<b>150</b>	<b>150</b>	<b>7516</b>	<b>7516</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.