

**Fecha de Publicación: 3 de noviembre de 2017**

**Fecha de Información: 01 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\$2839.0 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 3.4%.<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         | 624.8               | 315.7         | 64.3                      | 368.8        | 102.4         | 107.0        | 149.0          |
| 15-35        | 913.3               | 888.2         | 497.5                     | 300.8        | 144.1         | 366.0        | 246.6          |
| 36-60        | 114.7               | 66.2          | 3.0                       | 0.0          | 53.2          | 104.7        | 10.0           |
| 61-90        | 15.1                | 21.3          | 0.0                       | 0.0          | 21.3          | 15.1         | 0.0            |
| 91-180       | 38.5                | 62.7          | 50.0                      | 10.0         | 12.7          | 28.5         | 0.0            |
| >180         | 157.8               | 146.2         | 25.4                      | 0.0          | 0.8           | 37.8         | 120.0          |
| <b>Total</b> | <b>1864.2</b>       | <b>1500.4</b> | <b>640.2</b>              | <b>679.6</b> | <b>334.6</b>  | <b>659.1</b> | <b>525.6</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         | 3.5 %              | 2.8 %                        | 3.5 %        | 3.3 %        |
| 15-35        | 3.5 %              | 3.6 %                        | 3.5 %        | 3.5 %        |
| 36-60        | 3.5 %              | 3.9 %                        | 3.6 %        | 3.7 %        |
| 61-90        | -                  | 3.4 %                        | 2.9 %        | 3.2 %        |
| 91-180       | -                  | 3.3 %                        | 3.0 %        | 3.2 %        |
| >180         | 3.1 %              | 3.4 %                        | 2.9 %        | 3.1 %        |
| <b>Total</b> | <b>3.4 %</b>       | <b>3.4 %</b>                 | <b>3.4 %</b> | <b>3.4 %</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**       | 38                           | 96         | 5281        | 4452        | 39                   | 105        | 4134        | 4468        | 102                   | 115        | 3836        | 3924        |
| Intragrupo y off-shore*** | 0                            | 0          | 1650        | 1668        | 0                    | 0          | 1784        | 799         | 0                     | 0          | 1691        | 843         |
| Otros                     | 96                           | 38         | 1092        | 1904        | 105                  | 39         | 1085        | 1736        | 115                   | 102        | 1187        | 1947        |
| <b>Total</b>              | <b>135</b>                   | <b>135</b> | <b>8023</b> | <b>8023</b> | <b>143</b>           | <b>143</b> | <b>7003</b> | <b>7003</b> | <b>217</b>            | <b>217</b> | <b>6714</b> | <b>6714</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.