

Fecha de Publicación: 10 de agosto de 2017

Fecha de Información: 08 de agosto 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\$2170.9 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 4.8%.<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	282.1	404.2	347.1	214.0	16.6	27.5	40.5
15-35	754.9	780.4	417.5	302.4	52.7	142.2	310.3
36-60	40.8	34.4	0.0	0.0	4.4	10.8	30.0
61-90	8.5	8.7	0.0	0.0	8.7	8.5	0.0
91-180	64.9	164.9	109.2	50.0	45.7	4.9	10.0
>180	12.8	5.2	0.0	10.0	5.2	2.8	0.0
<b>Total</b>	<b>1164.0</b>	<b>1397.7</b>	<b>873.7</b>	<b>576.5</b>	<b>133.2</b>	<b>196.8</b>	<b>390.8</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	4.6 %	5.9 %	4.3 %	5.4 %
15-35	4.8 %	4.8 %	4.2 %	4.5 %
36-60	4.5 %	6.0 %	4.4 %	4.6 %
61-90	-	5.2 %	4.3 %	4.7 %
91-180	4.3 %	4.7 %	4.4 %	4.5 %
>180	-	4.5 %	4.1 %	4.2 %
<b>Total</b>	<b>4.7 %</b>	<b>5.2 %</b>	<b>4.2 %</b>	<b>4.8 %</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

Sector	7 al 11 de agosto				14 al 18 de agosto				21 al 25 de agosto			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
<b>Sector Financiero**</b>	21	85	4029	4352	24	144	3302	4257	50	104	3027	2449
<b>Intragruppo y off-shore***</b>	0	0	2240	1502	0	0	2524	1073	0	0	1362	1594
<b>Otros</b>	85	21	679	1094	144	24	606	1102	104	50	423	769
<b>Total</b>	<b>106</b>	<b>106</b>	<b>6948</b>	<b>6948</b>	<b>168</b>	<b>168</b>	<b>6431</b>	<b>6431</b>	<b>154</b>	<b>154</b>	<b>4812</b>	<b>4812</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:  $((\text{Tasa Pactada}/\text{Tasa de Contado}) \wedge (360/\text{Plazo})) - 1$ . Para el cálculo de la devaluación implícita se excluyen las operaciones intragruppo.