

Fecha de Publicación: 11 de agosto de 2017

Fecha de Información: 09 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\$1895.2 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 4.8%.<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	249.8	164.7	83.0	150.0	21.2	39.3	60.5
15-35	795.2	1048.6	600.0	100.8	48.6	294.5	400.0
36-60	5.9	2.7	0.0	0.0	2.7	5.9	0.0
61-90	16.6	1.3	0.0	0.0	1.3	16.6	0.0
91-180	2.8	4.6	0.0	0.0	4.6	2.8	0.0
>180	61.4	47.1	0.0	12.0	2.1	4.4	45.0
<b>Total</b>	<b>1131.7</b>	<b>1269.0</b>	<b>683.0</b>	<b>262.8</b>	<b>80.5</b>	<b>363.4</b>	<b>505.5</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	4.2 %	4.2 %	4.8 %	4.5 %
15-35	4.9 %	5.1 %	4.6 %	4.9 %
36-60	-	5.1 %	4.4 %	4.6 %
61-90	-	5.6 %	4.1 %	4.2 %
91-180	-	5.1 %	3.9 %	4.6 %
>180	4.2 %	4.5 %	4.0 %	4.2 %
<b>Total</b>	<b>4.7 %</b>	<b>5.0 %</b>	<b>4.6 %</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
Sector Financiero**	24	87	4185	4408	23	145	3380	4353	51	104	3066	2502
Intragrupa y off-shore***	0	0	2281	1645	0	0	2566	1080	0	0	1382	1594
Otros	87	24	684	1097	145	23	616	1129	104	51	430	783
<b>Total</b>	<b>111</b>	<b>111</b>	<b>7150</b>	<b>7150</b>	<b>168</b>	<b>168</b>	<b>6562</b>	<b>6562</b>	<b>155</b>	<b>155</b>	<b>4879</b>	<b>4879</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.