

Fecha de Publicación: 28 de agosto de 2017

Fecha de Información: 24 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\$1568.5 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	394.8	315.9	69.0	125.0	86.9	109.8	160.0
15-35	576.7	633.5	220.5	145.5	101.0	119.2	312.0
36-60	6.5	12.0	0.0	0.0	11.0	5.5	1.0
61-90	42.3	10.1	0.0	0.0	10.1	42.3	0.0
91-180	0.8	23.5	0.0	0.0	23.5	0.8	0.0
>180	11.5	13.7	0.0	11.5	13.7	0.0	0.0
<b>Total</b>	<b>1032.7</b>	<b>1008.8</b>	<b>289.5</b>	<b>282.0</b>	<b>246.3</b>	<b>277.7</b>	<b>473.0</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	4.7 %	4.9 %	4.7 %	4.8 %
15-35	4.8 %	4.9 %	4.8 %	4.8 %
36-60	4.6 %	5.2 %	4.1 %	4.8 %
61-90	-	4.8 %	4.5 %	4.6 %
91-180	-	4.8 %	4.4 %	4.8 %
>180	-	4.6 %	4.2 %	4.4 %
<b>Total</b>	<b>4.8 %</b>	<b>4.9 %</b>	<b>4.7 %</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	21 al 25 de agosto				28 de ago. al 1 de septiembre				4 al 8 de septiembre			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
<b>Sector Financiero**</b>	28	115	3166	3253	163	134	4891	5338	12	82	4002	3433
<b>Intragrupa y off-shore***</b>	0	0	1644	1200	0	0	2080	1343	0	0	1790	1598
<b>Otros</b>	115	28	735	1093	134	163	1486	1767	82	12	582	1342
<b>Total</b>	<b>143</b>	<b>143</b>	<b>5546</b>	<b>5546</b>	<b>297</b>	<b>297</b>	<b>8457</b>	<b>8448</b>	<b>93</b>	<b>93</b>	<b>6373</b>	<b>6373</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.