

Fecha de Publicación: 29 de agosto de 2017

Fecha de Información: 25 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\$1858.8 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 5.1%.<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	108.3	207.1	86.0	18.1	56.1	25.2	65.0
15-35	641.5	669.7	277.8	308.5	104.9	46.0	287.0
36-60	3.0	49.9	2.0	0.0	47.9	3.0	0.0
61-90	102.6	74.8	0.8	101.7	74.1	0.9	0.0
91-180	133.4	201.1	0.1	70.0	167.0	29.4	34.0
>180	6.5	52.0	10.0	0.0	37.0	1.5	5.0
<b>Total</b>	<b>995.3</b>	<b>1254.5</b>	<b>376.6</b>	<b>498.3</b>	<b>487.0</b>	<b>106.0</b>	<b>391.0</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 intragruppo		Total
	Compras/Ventas	Compras	Ventas	
3-14	4.9 %	6.3 %	4.7 %	5.6 %
15-35	5.0 %	5.3 %	4.8 %	5.0 %
36-60	-	5.3 %	4.5 %	5.2 %
61-90	-	5.1 %	4.7 %	4.9 %
91-180	4.5 %	4.9 %	4.2 %	4.8 %
>180	4.3 %	4.5 %	4.2 %	4.5 %
<b>Total</b>	<b>4.9 %</b>	<b>5.3 %</b>	<b>4.8 %</b>	<b>5.1 %</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	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
Sector Financiero**	25	114	3168	3291	165	142	4972	5417	12	87	4041	3517
Intragruppo y off-shore***	0	0	1644	1200	0	0	2105	1355	0	0	1851	1604
Otros	114	25	773	1095	142	165	1490	1786	87	12	589	1360
<b>Total</b>	<b>139</b>	<b>139</b>	<b>5586</b>	<b>5586</b>	<b>307</b>	<b>307</b>	<b>8567</b>	<b>8557</b>	<b>98</b>	<b>98</b>	<b>6481</b>	<b>6481</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 intragruppo.