

Fecha de Publicación: 4 de septiembre de 2017

Fecha de Información: 31 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\$1983.9 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 5.0%.<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	595.2	408.9	51.0	263.4	237.2	211.1	120.8
15-35	622.7	448.9	226.8	224.0	62.8	239.5	159.3
36-60	4.2	8.0	0.0	0.0	8.0	4.2	0.0
61-90	28.2	41.2	0.0	0.0	33.2	20.2	8.0
91-180	1.4	34.3	0.0	0.0	34.3	1.4	0.0
>180	18.5	66.4	55.0	10.0	5.4	2.5	6.0
<b>Total</b>	<b>1270.2</b>	<b>1007.7</b>	<b>332.8</b>	<b>497.4</b>	<b>380.8</b>	<b>478.8</b>	<b>294.0</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	4.8 %	5.1 %	5.1 %	5.0 %
15-35	4.9 %	5.4 %	5.0 %	5.0 %
36-60	-	5.5 %	4.6 %	5.2 %
61-90	4.7 %	5.1 %	4.5 %	4.8 %
91-180	-	4.7 %	3.8 %	4.7 %
>180	4.1 %	4.4 %	3.8 %	4.3 %
<b>Total</b>	<b>4.8 %</b>	<b>5.0 %</b>	<b>5.0 %</b>	<b>5.0 %</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	28 de ago. al 1 de septiembre				4 al 8 de septiembre				11 al 15 de septiembre			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
<b>Sector Financiero**</b>	165	145	6041	6018	13	89	4558	4103	26	138	3132	3440
<b>Intragruppo y off-shore***</b>	0	0	2282	1942	0	0	1953	1617	0	0	1796	996
<b>Otros</b>	145	165	1836	2190	89	13	894	1685	138	26	753	1244
<b>Total</b>	<b>310</b>	<b>310</b>	<b>10159</b>	<b>10149</b>	<b>102</b>	<b>102</b>	<b>7405</b>	<b>7405</b>	<b>163</b>	<b>163</b>	<b>5680</b>	<b>5680</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.