

Fecha de Publicación: 7 de septiembre de 2017

Fecha de Información: 05 de septiembre 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\$1871.1 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	373.0	211.5	38.1	207.5	40.9	33.0	132.5
15-35	707.6	723.1	249.8	115.5	162.3	281.1	311.0
36-60	7.7	30.2	0.0	0.0	30.2	7.7	0.0
61-90	4.0	29.6	2.0	0.0	27.6	4.0	0.0
91-180	70.9	67.2	0.0	30.0	27.2	0.9	40.0
>180	62.6	117.4	30.0	9.7	37.4	2.9	50.0
<b>Total</b>	<b>1225.7</b>	<b>1178.9</b>	<b>319.9</b>	<b>362.7</b>	<b>325.5</b>	<b>329.5</b>	<b>533.5</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	4.7 %	4.7 %	5.1 %	4.9 %
15-35	4.8 %	4.9 %	4.7 %	4.8 %
36-60	-	5.1 %	4.7 %	5.0 %
61-90	-	4.7 %	4.4 %	4.7 %
91-180	4.4 %	4.9 %	4.4 %	4.5 %
>180	4.2 %	4.2 %	4.0 %	4.2 %
<b>Total</b>	<b>4.7 %</b>	<b>4.8 %</b>	<b>4.8 %</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	4 al 8 de septiembre				11 al 15 de septiembre				18 al 22 de septiembre			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	27	101	4657	4428	18	139	3943	3740	9	169	3112	3264
Intragruppo y off-shore***	0	0	2042	1435	0	0	1857	1559	0	0	1781	996
Otros	101	27	927	1763	139	18	961	1460	169	9	580	1214
<b>Total</b>	<b>127</b>	<b>127</b>	<b>7627</b>	<b>7627</b>	<b>157</b>	<b>157</b>	<b>6760</b>	<b>6760</b>	<b>177</b>	<b>177</b>	<b>5474</b>	<b>5474</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 intragrupo.