

Fecha de Publicación: 8 de septiembre de 2017

Fecha de Información: 06 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\$2356.3 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	597.1	200.6	70.0	483.2	39.6	22.9	91.0
15-35	790.0	835.7	431.5	198.8	168.7	355.7	235.5
36-60	0.6	19.2	0.0	0.0	19.2	0.6	0.0
61-90	65.7	31.6	0.0	10.2	31.6	55.4	0.0
91-180	75.3	112.0	20.2	20.0	37.8	1.3	54.0
>180	1.3	7.7	0.0	0.0	7.7	1.3	0.0
<b>Total</b>	<b>1530.0</b>	<b>1206.8</b>	<b>521.7</b>	<b>712.2</b>	<b>304.6</b>	<b>437.3</b>	<b>380.5</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	4.9 %	5.0 %	4.8 %	4.9 %
15-35	4.8 %	4.8 %	4.8 %	4.8 %
36-60	-	5.1 %	4.5 %	5.1 %
61-90	-	4.7 %	4.5 %	4.6 %
91-180	4.3 %	4.8 %	4.3 %	4.5 %
>180	-	4.7 %	4.2 %	4.6 %
<b>Total</b>	<b>4.8 %</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
<b>Sector Financiero**</b>	27	101	4994	4505	18	140	4035	3792	9	170	3212	3303
<b>Intragrupa y off-shore***</b>	0	0	2047	1700	0	0	1869	1635	0	0	1801	1070
<b>Otros</b>	101	27	927	1764	140	18	994	1470	170	9	587	1227
<b>Total</b>	<b>127</b>	<b>127</b>	<b>7969</b>	<b>7969</b>	<b>158</b>	<b>158</b>	<b>6897</b>	<b>6897</b>	<b>178</b>	<b>178</b>	<b>5600</b>	<b>5600</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.