

Fecha de Publicación: 29 de septiembre de 2017

Fecha de Información: 27 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\$2703.7 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 4.6%.<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	523.2	278.4	40.3	305.5	152.7	132.2	85.5
15-35	833.7	1031.0	628.0	228.8	148.5	350.4	254.5
36-60	10.4	3.3	0.0	0.0	3.3	10.4	0.0
61-90	80.8	73.2	66.7	65.5	6.5	15.3	0.0
91-180	167.4	18.6	0.0	160.0	13.6	2.4	5.0
>180	7.3	21.3	20.0	0.0	1.3	7.3	0.0
<b>Total</b>	<b>1622.9</b>	<b>1425.9</b>	<b>755.0</b>	<b>759.8</b>	<b>325.9</b>	<b>518.1</b>	<b>345.0</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	4.6 %	4.7 %	4.4 %	4.6 %
15-35	4.7 %	4.8 %	4.6 %	4.7 %
36-60	-	5.3 %	4.3 %	4.5 %
61-90	-	4.2 %	4.1 %	4.2 %
91-180	3.9 %	4.6 %	3.9 %	4.0 %
>180	-	3.7 %	3.1 %	3.5 %
<b>Total</b>	<b>4.7 %</b>	<b>4.7 %</b>	<b>4.4 %</b>	<b>4.6 %</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	25 al 29 de septiembre				2 al 6 de octubre				9 al 13 de octubre			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
<b>Sector Financiero**</b>	32	152	5952	5435	26	159	4538	4868	8	106	3861	3661
<b>Intragruppo y off-shore***</b>	0	0	2441	2784	0	0	1989	1019	0	0	1531	1023
<b>Otros</b>	152	32	1158	1332	159	26	983	1623	105	8	937	1644
<b>Total</b>	<b>184</b>	<b>184</b>	<b>9551</b>	<b>9551</b>	<b>185</b>	<b>185</b>	<b>7510</b>	<b>7510</b>	<b>114</b>	<b>114</b>	<b>6329</b>	<b>6329</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.