

Fecha de Publicación: 14 de septiembre de 2017

Fecha de Información: 12 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\$1654.8 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 4.7%.<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	284.1	270.4	119.9	145.4	38.5	26.6	112.0
15-35	416.8	500.0	228.4	92.6	138.5	191.1	133.1
36-60	159.3	126.4	0.0	0.0	106.4	139.3	20.0
61-90	33.2	11.7	0.0	0.0	11.7	33.2	0.0
91-180	40.2	18.8	0.0	40.0	18.8	0.2	0.0
>180	20.0	39.0	21.0	10.0	18.0	10.0	0.0
<b>Total</b>	<b>953.6</b>	<b>966.2</b>	<b>369.3</b>	<b>288.0</b>	<b>331.8</b>	<b>400.5</b>	<b>265.1</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 %	4.6 %	4.6 %	4.7 %
15-35	4.6 %	5.0 %	4.4 %	4.7 %
36-60	4.5 %	4.8 %	4.6 %	4.7 %
61-90	-	4.8 %	4.1 %	4.3 %
91-180	-	4.4 %	4.2 %	4.3 %
>180	-	4.1 %	4.0 %	4.1 %
<b>Total</b>	<b>4.6 %</b>	<b>4.8 %</b>	<b>4.5 %</b>	<b>4.7 %</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	11 al 15 de septiembre				18 al 22 de septiembre				25 al 29 de septiembre			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
<b>Sector Financiero**</b>	18	141	4393	4188	13	153	4109	3860	16	143	3532	3818
<b>Intragrupa y off-shore***</b>	0	0	2005	1613	0	0	2101	1779	0	0	1518	1091
<b>Otros</b>	141	18	1023	1620	153	13	684	1255	143	16	972	1114
<b>Total</b>	<b>159</b>	<b>159</b>	<b>7421</b>	<b>7421</b>	<b>166</b>	<b>166</b>	<b>6895</b>	<b>6895</b>	<b>159</b>	<b>159</b>	<b>6022</b>	<b>6022</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:  $((\text{Tasa Pactada}/\text{Tasa de Contado})^{\frac{360}{\text{Plazo}}}) - 1$ . Para el cálculo de la devaluación implícita se excluyen las operaciones intragrupo.