

**Fecha de Publicación: 19 de septiembre de 2017**

**Fecha de Información: 15 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\$1397.6 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 4.4%.<sup>2</sup>

**Cuadro No. 1**  
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero**		Intragruo y Off-shore***		Otros Agentes		Interbancarios
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	272.1	222.3	74.5	151.5	52.8	25.6	95.0
15-35	378.9	443.7	203.5	103.7	38.2	73.2	202.0
36-60	88.1	92.0	0.0	0.0	92.0	88.1	0.0
61-90	19.6	44.2	15.0	0.0	11.2	1.6	18.0
91-180	49.7	72.8	10.0	0.0	24.8	11.7	38.0
>180	37.0	55.1	20.0	10.0	10.1	2.0	25.0
<b>Total</b>	<b>845.4</b>	<b>930.2</b>	<b>323.0</b>	<b>265.2</b>	<b>229.1</b>	<b>202.2</b>	<b>378.0</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 intragruo		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	4.4 %		4.9 %	4.3 %	4.6 %
15-35	4.5 %		4.5 %	3.8 %	4.3 %
36-60	-		4.5 %	4.4 %	4.5 %
61-90	4.2 %		4.3 %	3.8 %	4.3 %
91-180	4.2 %		4.4 %	3.9 %	4.2 %
>180	3.9 %		4.0 %	3.9 %	3.9 %
<b>Total</b>	<b>4.4 %</b>		<b>4.6 %</b>	<b>4.1 %</b>	<b>4.4 %</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
Sector Financiero**	19	136	4435	4239	16	155	4995	4375	17	144	3786	4037
Intragruo y off-shore***	0	0	2017	1640	0	0	2421	2415	0	0	1522	1163
Otros	136	19	1047	1620	155	16	688	1314	144	17	1059	1167
<b>Total</b>	<b>154</b>	<b>154</b>	<b>7499</b>	<b>7499</b>	<b>171</b>	<b>171</b>	<b>8104</b>	<b>8104</b>	<b>161</b>	<b>161</b>	<b>6367</b>	<b>6367</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 intragruo.