

Fecha de Publicación: 25 de septiembre de 2017

Fecha de Información: 21 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\$2788.9 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 4.4%.<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	709.6	636.5	501.0	563.7	18.0	28.4	117.5
15-35	804.8	718.3	314.5	168.0	12.8	245.8	391.0
36-60	152.6	173.6	30.0	0.0	113.6	122.6	30.0
61-90	35.0	45.2	21.4	24.5	18.8	5.5	5.0
91-180	0.7	19.2	10.0	0.0	9.2	0.7	0.0
>180	23.6	33.2	10.0	0.0	3.2	3.6	20.0
<b>Total</b>	<b>1726.3</b>	<b>1626.0</b>	<b>886.9</b>	<b>756.2</b>	<b>175.7</b>	<b>406.6</b>	<b>563.5</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 intragruppo		Total
	Compras/Ventas	Compras	Ventas	
3-14	4.5 %	4.6 %	4.8 %	4.7 %
15-35	4.4 %	4.2 %	4.3 %	4.3 %
36-60	4.2 %	4.8 %	4.4 %	4.6 %
61-90	4.2 %	4.8 %	4.0 %	4.4 %
91-180	-	5.0 %	3.3 %	4.9 %
>180	3.9 %	4.0 %	3.7 %	3.9 %
<b>Total</b>	<b>4.4 %</b>	<b>4.5 %</b>	<b>4.4 %</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	18 al 22 de septiembre				25 al 29 de septiembre				2 al 6 de octubre			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
<b>Sector Financiero**</b>	15	161	5592	4910	20	146	5139	5110	15	158	4153	4254
<b>Intragruppo y off-shore***</b>	0	0	2865	2920	0	0	2268	2149	0	0	1699	930
<b>Otros</b>	161	15	691	1319	146	20	1145	1293	158	15	903	1572
<b>Total</b>	<b>176</b>	<b>176</b>	<b>9149</b>	<b>9149</b>	<b>167</b>	<b>167</b>	<b>8552</b>	<b>8552</b>	<b>174</b>	<b>174</b>	<b>6755</b>	<b>6755</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.