

**Fecha de Publicación: 2 de octubre de 2017**

**Fecha de Información: 28 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\$1468.8 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 4.5%.<sup>2</sup>

**Cuadro No. 1  
Contratos Forwards Pactados**

Rango	Sector Financiero**		Intragrupo y Off-shore***		Otros Agentes		Interbancarios
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	241.5	168.7	118.3	172.5	5.5	24.0	45.0
15-35	641.5	481.8	185.1	285.8	165.0	224.0	131.8
36-60	8.0	6.1	0.0	0.0	6.1	8.0	0.0
61-90	5.5	27.8	14.2	0.0	13.6	5.5	0.0
91-180	0.4	41.3	30.0	0.0	11.3	0.4	0.0
>180	2.0	20.9	20.0	0.0	0.9	2.0	0.0
<b>Total</b>	<b>898.8</b>	<b>746.7</b>	<b>367.5</b>	<b>458.3</b>	<b>202.5</b>	<b>263.8</b>	<b>176.8</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	
3-14	3.5 %	4.3 %	4.2 %	4.1 %
15-35	4.7 %	5.0 %	4.5 %	4.7 %
36-60	-	4.5 %	4.3 %	4.4 %
61-90	-	4.3 %	4.1 %	4.3 %
91-180	-	4.0 %	4.0 %	4.0 %
>180	-	3.7 %	3.5 %	3.6 %
<b>Total</b>	<b>4.4 %</b>	<b>4.6 %</b>	<b>4.4 %</b>	<b>4.5 %</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	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
Sector Financiero**	32	152	6036	5448	26	157	4599	4971	8	106	4013	3768
Intragrupo y off-shore***	0	0	2444	2857	0	0	2074	1056	0	0	1561	1086
Otros	152	32	1160	1335	157	26	985	1630	106	8	939	1659
<b>Total</b>	<b>184</b>	<b>184</b>	<b>9639</b>	<b>9639</b>	<b>184</b>	<b>184</b>	<b>7658</b>	<b>7658</b>	<b>114</b>	<b>114</b>	<b>6513</b>	<b>6513</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 intragrupo.