

Fecha de Publicación: 7 de julio de 2017

Fecha de Información: 05 de julio 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\$2088.7 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 4.8%.<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	300.6	120.1	19.5	180.8	13.1	32.3	87.5
15-35	877.8	954.0	455.5	200.1	173.5	352.7	325.0
36-60	4.9	6.5	3.5	0.0	3.0	4.9	0.0
61-90	49.6	23.2	0.0	0.0	3.2	29.6	20.0
91-180	21.7	110.6	65.1	0.1	28.5	4.6	17.0
>180	41.6	37.8	20.0	15.2	7.8	16.4	10.0
<b>Total</b>	<b>1296.1</b>	<b>1252.1</b>	<b>563.6</b>	<b>396.2</b>	<b>229.0</b>	<b>440.4</b>	<b>459.5</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 intragrupo		Total
	Compras/Ventas	Compras	Ventas	
3-14	5.0 %	5.0 %	5.3 %	5.2 %
15-35	4.8 %	4.9 %	4.9 %	4.9 %
36-60	-	4.9 %	4.3 %	4.6 %
61-90	4.6 %	4.7 %	4.3 %	4.5 %
91-180	4.3 %	4.6 %	3.9 %	4.5 %
>180	4.2 %	4.4 %	4.1 %	4.2 %
<b>Total</b>	<b>4.8 %</b>	<b>4.8 %</b>	<b>4.9 %</b>	<b>4.8 %</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	3 al 7 de julio				10 al 14 de julio				17 al 21 de julio			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
<b>Sector Financiero**</b>	23	91	2330	2416	23	79	2678	2989	66	95	2556	3527
<b>Intragrupa y off-shore***</b>	0	0	1244	953	0	0	1515	609	0	0	2269	723
<b>Otros</b>	91	23	503	707	79	23	757	1343	95	66	447	1021
<b>Total</b>	<b>114</b>	<b>114</b>	<b>4076</b>	<b>4076</b>	<b>102</b>	<b>102</b>	<b>4951</b>	<b>4941</b>	<b>161</b>	<b>161</b>	<b>5272</b>	<b>5272</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:  $((\text{Tasa Pactada}/\text{Tasa de Contado}) \wedge (360/\text{Plazo})) - 1$ . Para el cálculo de la devaluación implícita se excluyen las operaciones intragrupo.