

Fecha de Publicación: 10 de julio de 2017

Fecha de Información: 06 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\$1845.9 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 4.6%.<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	136.8	167.5	103.0	55.0	28.5	45.8	36.0
15-35	720.9	825.5	519.2	238.2	45.7	222.0	260.6
36-60	1.6	65.5	41.0	0.0	24.5	1.6	0.0
61-90	68.1	3.4	0.0	0.0	3.4	68.1	0.0
91-180	13.0	50.9	30.0	0.0	20.9	13.0	0.0
>180	62.0	67.4	25.0	10.0	2.4	12.0	40.0
<b>Total</b>	<b>1002.3</b>	<b>1180.2</b>	<b>718.2</b>	<b>303.2</b>	<b>125.4</b>	<b>362.4</b>	<b>336.6</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	4.9 %	5.4 %	1.4 %	3.6 %
15-35	4.8 %	4.9 %	4.7 %	4.8 %
36-60	-	4.9 %	3.0 %	4.8 %
61-90	-	4.8 %	4.3 %	4.3 %
91-180	-	4.5 %	4.0 %	4.4 %
>180	4.2 %	4.3 %	4.0 %	4.2 %
<b>Total</b>	<b>4.7 %</b>	<b>4.9 %</b>	<b>4.1 %</b>	<b>4.6 %</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
Sector Financiero**	23	85	2336	2431	40	77	2742	3095	66	97	2608	3598
Intragruppo y off-shore***	0	0	1244	962	0	0	1583	640	0	0	2313	738
Otros	85	23	518	705	77	40	777	1358	97	66	456	1040
<b>Total</b>	<b>108</b>	<b>108</b>	<b>4098</b>	<b>4098</b>	<b>118</b>	<b>118</b>	<b>5103</b>	<b>5093</b>	<b>163</b>	<b>163</b>	<b>5377</b>	<b>5377</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.