

Fecha de Publicación: 11 de julio de 2017

Fecha de Información: 07 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\$1343.4 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 5.1%.<sup>2</sup>

**Cuadro No. 1**  
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero**		Intragrupos y Off-shore***		Otros Agentes		Interbancarios
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	351.3	264.2	47.5	99.3	10.9	46.3	205.8
15-35	485.0	640.2	327.5	70.5	41.7	143.5	271.0
36-60	4.1	8.8	0.0	0.0	8.8	4.1	0.0
61-90	5.5	4.0	0.0	0.0	4.0	5.5	0.0
91-180	20.4	15.1	0.0	1.2	13.1	17.2	2.0
>180	8.4	15.2	10.0	0.0	5.2	8.4	0.0
<b>Total</b>	<b>874.7</b>	<b>947.5</b>	<b>385.0</b>	<b>170.9</b>	<b>83.7</b>	<b>225.0</b>	<b>478.8</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	Compras	Ventas	
3-14	4.8 %	5.2 %	8.7 %	6.2 %
15-35	4.8 %	4.8 %	4.6 %	4.7 %
36-60	-	4.9 %	3.4 %	4.4 %
61-90	-	4.9 %	3.5 %	4.1 %
91-180	4.3 %	4.9 %	3.9 %	4.3 %
>180	-	4.4 %	3.9 %	4.2 %
<b>Total</b>	<b>4.8 %</b>	<b>4.9 %</b>	<b>5.9 %</b>	<b>5.1 %</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	85	2336	2432	42	81	2905	3192	67	95	2793	3765
<b>Intragrupos y off-shore***</b>	0	0	1244	962	0	0	1624	739	0	0	2320	738
<b>Otros</b>	85	23	518	705	81	42	786	1374	95	67	458	1068
<b>Total</b>	<b>108</b>	<b>108</b>	<b>4099</b>	<b>4099</b>	<b>123</b>	<b>123</b>	<b>5315</b>	<b>5305</b>	<b>161</b>	<b>161</b>	<b>5571</b>	<b>5571</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.