

Fecha de Publicación: 12 de julio de 2017

Fecha de Información: 10 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\$1070.3 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 4.9%.<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	160.1	101.2	63.5	110.7	12.5	24.2	25.3
15-35	466.0	385.8	129.5	136.3	23.1	96.5	233.3
36-60	59.4	32.2	0.0	0.0	17.2	44.4	15.0
61-90	7.3	10.1	1.8	0.0	8.3	7.3	0.0
91-180	34.6	40.6	1.5	0.0	24.1	19.6	15.0
>180	35.1	41.6	5.0	20.0	21.6	0.1	15.0
<b>Total</b>	<b>762.5</b>	<b>611.4</b>	<b>201.3</b>	<b>266.9</b>	<b>106.6</b>	<b>192.1</b>	<b>303.5</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	4.9 %	5.3 %	4.7 %	5.0 %
15-35	4.9 %	5.7 %	4.7 %	5.0 %
36-60	4.8 %	5.0 %	4.4 %	4.6 %
61-90	-	4.8 %	3.5 %	4.2 %
91-180	4.5 %	4.7 %	4.3 %	4.5 %
>180	4.3 %	4.5 %	4.3 %	4.4 %
<b>Total</b>	<b>4.8 %</b>	<b>5.3 %</b>	<b>4.6 %</b>	<b>4.9 %</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	10 al 14 de julio				17 al 21 de julio				24 al 28 de julio			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	44	85	3013	3275	71	98	2840	3775	19	90	3986	3512
Intragruppo y off-shore***	0	0	1686	819	0	0	2321	769	0	0	1654	1596
Otros	85	44	791	1387	98	71	457	1074	90	19	888	1420
<b>Total</b>	<b>129</b>	<b>129</b>	<b>5491</b>	<b>5481</b>	<b>169</b>	<b>169</b>	<b>5618</b>	<b>5618</b>	<b>108</b>	<b>108</b>	<b>6529</b>	<b>6529</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 intragruppo.