

Fecha de Publicación: 21 de julio de 2017

Fecha de Información: 18 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\$2482.8 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 4.5%.<sup>2</sup>

**Cuadro No. 1**  
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero**		Intragruppo y Off-shore***		Otros Agentes		Interbancarios
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	550.6	124.0	35.3	509.9	63.7	15.7	25.0
15-35	590.3	1096.2	795.0	172.6	57.2	173.7	244.0
36-60	59.9	10.6	0.0	0.0	10.6	59.9	0.0
61-90	10.6	59.5	50.0	10.0	9.5	0.6	0.0
91-180	147.5	53.0	0.0	130.0	38.0	2.5	15.0
>180	18.9	63.6	38.0	0.0	7.6	0.9	18.0
<b>Total</b>	<b>1377.9</b>	<b>1406.9</b>	<b>918.3</b>	<b>822.5</b>	<b>186.6</b>	<b>253.3</b>	<b>302.0</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	4.6 %	5.4 %	5.2 %	5.2 %
15-35	4.9 %	4.1 %	4.7 %	4.4 %
36-60	-	5.2 %	4.7 %	4.8 %
61-90	-	1.8 %	4.7 %	2.2 %
91-180	4.6 %	4.7 %	4.6 %	4.6 %
>180	4.3 %	4.4 %	4.0 %	4.4 %
<b>Total</b>	<b>4.9 %</b>	<b>4.1 %</b>	<b>4.9 %</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	17 al 21 de julio				24 al 28 de julio				31 de jul. al 4 de agosto			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	26	112	4321	4375	25	109	4895	4388	12	104	2954	3404
Intragruppo y off-shore***	0	0	2594	1883	0	0	2132	2178	0	0	1918	910
Otros	112	26	503	1161	109	25	1025	1486	104	12	517	1074
<b>Total</b>	<b>138</b>	<b>138</b>	<b>7419</b>	<b>7419</b>	<b>134</b>	<b>134</b>	<b>8053</b>	<b>8053</b>	<b>115</b>	<b>115</b>	<b>5388</b>	<b>5388</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.