

Fecha de Publicación: 24 de julio de 2017

Fecha de Información: 19 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\$1818.8 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 4.6%.<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	483.7	476.0	381.2	400.8	50.9	38.9	44.0
15-35	439.2	394.7	240.5	129.3	51.0	206.7	103.3
36-60	0.8	43.3	32.0	0.0	11.3	0.8	0.0
61-90	10.7	26.4	0.0	0.0	16.4	0.7	10.0
91-180	35.0	57.7	0.0	0.0	23.7	1.0	34.0
>180	21.5	27.1	0.0	1.6	21.1	13.9	6.0
<b>Total</b>	<b>990.8</b>	<b>1025.2</b>	<b>653.7</b>	<b>531.7</b>	<b>174.3</b>	<b>261.9</b>	<b>197.3</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	6.4 %	5.4 %	3.7 %	5.1 %
15-35	5.0 %	4.6 %	4.2 %	4.5 %
36-60	-	5.1 %	4.4 %	5.1 %
61-90	4.6 %	4.9 %	4.3 %	4.8 %
91-180	4.6 %	4.9 %	4.3 %	4.7 %
>180	4.0 %	4.3 %	3.8 %	4.1 %
<b>Total</b>	<b>5.2 %</b>	<b>4.7 %</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	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	C	V						
Sector Financiero**	26	110	4369	4428	26	110	5064	4803	12	105	3235	3433								
Intragrupa y off-shore***	0	0	2623	1908	0	0	2484	2293	0	0	1918	1170								
Otros	110	26	507	1163	110	26	1064	1516	105	12	541	1091								
<b>Total</b>	<b>136</b>	<b>136</b>	<b>7499</b>	<b>7499</b>	<b>136</b>	<b>136</b>	<b>8613</b>	<b>8613</b>	<b>117</b>	<b>117</b>	<b>5694</b>	<b>5694</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.

1 Datos provisionales.

2 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.