

Fecha de Publicación: 28 de julio de 2017

Fecha de Información: 26 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\$1375.7 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 3.1%.<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	349.4	121.4	13.5	218.8	44.1	66.9	63.8
15-35	465.0	508.4	232.0	184.5	120.4	124.5	156.0
36-60	0.5	4.9	0.0	0.0	4.9	0.5	0.0
61-90	2.4	10.9	0.0	0.0	10.9	2.4	0.0
91-180	30.6	67.3	0.0	10.0	57.3	10.6	10.0
>180	21.1	23.7	21.5	20.0	2.2	1.1	0.0
<b>Total</b>	<b>869.0</b>	<b>736.5</b>	<b>267.0</b>	<b>433.3</b>	<b>239.7</b>	<b>206.0</b>	<b>229.8</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 intragruppo		Total
	Compras/Ventas	Compras	Ventas	
3-14	5.0 %	5.7 %	-5.2 %	-1.4 %
15-35	5.1 %	4.4 %	4.9 %	4.7 %
36-60	-	5.5 %	3.2 %	5.3 %
61-90	-	4.9 %	4.4 %	4.8 %
91-180	4.5 %	4.6 %	4.5 %	4.6 %
>180	-	4.3 %	4.2 %	4.3 %
<b>Total</b>	<b>5.0 %</b>	<b>4.6 %</b>	<b>1.0 %</b>	<b>3.1 %</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

Sectores	24 al 28 de julio				31 de jul. al 4 de agosto				7 al 11 de agosto			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
<b>Sector Financiero**</b>	40	112	5362	5122	15	112	3767	3574	64	63	3033	3680
<b>Intragruppo y off-shore***</b>	0	0	2613	2358	0	0	1968	1623	0	0	1990	895
<b>Otros</b>	112	40	1075	1571	112	15	599	1137	63	64	531	978
<b>Total</b>	<b>152</b>	<b>152</b>	<b>9050</b>	<b>9050</b>	<b>127</b>	<b>127</b>	<b>6334</b>	<b>6334</b>	<b>127</b>	<b>127</b>	<b>5553</b>	<b>5553</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.