

Fecha de Publicación: 31 de julio de 2017

Fecha de Información: 27 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\$2409.3 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 4.8%.<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	519.0	145.0	13.8	398.2	46.2	35.9	85.0
15-35	781.9	768.1	335.5	233.8	341.6	457.2	91.0
36-60	47.0	65.1	32.6	0.0	32.4	47.0	0.0
61-90	41.0	60.1	20.0	10.0	20.1	11.0	20.0
91-180	56.0	113.5	30.0	0.0	48.5	21.0	35.0
>180	1.7	41.9	21.4	0.0	20.5	1.7	0.0
<b>Total</b>	<b>1446.8</b>	<b>1193.6</b>	<b>453.3</b>	<b>641.9</b>	<b>509.3</b>	<b>573.9</b>	<b>231.0</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 intragruppo		Total
	Compras/Ventas	Compras	Ventas	
3-14	4.9 %	7.8 %	4.9 %	5.2 %
15-35	4.7 %	4.8 %	4.7 %	4.8 %
36-60	-	4.9 %	4.8 %	4.9 %
61-90	4.5 %	4.7 %	4.4 %	4.6 %
91-180	3.7 %	4.6 %	4.3 %	4.3 %
>180	-	4.3 %	3.6 %	4.3 %
<b>Total</b>	<b>4.6 %</b>	<b>5.0 %</b>	<b>4.8 %</b>	<b>4.8 %</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>	38	112	5147	5129	19	116	4400	3658	67	65	3128	3727
<b>Intragruppo y off-shore***</b>	0	0	2615	2136	0	0	1973	2173	0	0	1997	964
<b>Otros</b>	112	38	1076	1572	116	19	618	1159	65	67	551	984
<b>Total</b>	<b>150</b>	<b>150</b>	<b>8837</b>	<b>8837</b>	<b>135</b>	<b>135</b>	<b>6990</b>	<b>6990</b>	<b>133</b>	<b>133</b>	<b>5675</b>	<b>5675</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.