

Fecha de Publicación: 1 de agosto de 2017

Fecha de Información: 28 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\$1527.3 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	287.6	127.3	36.7	178.2	21.6	40.4	69.0
15-35	414.7	579.9	320.7	204.3	134.2	85.5	125.0
36-60	0.5	14.2	0.0	0.0	14.2	0.5	0.0
61-90	20.3	18.7	0.0	20.0	18.7	0.3	0.0
91-180	143.5	89.5	0.0	110.0	58.1	2.1	31.4
>180	0.7	55.6	40.0	0.0	15.6	0.7	0.0
<b>Total</b>	<b>867.3</b>	<b>885.3</b>	<b>397.4</b>	<b>512.5</b>	<b>262.6</b>	<b>129.5</b>	<b>225.4</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 %	6.2 %	4.2 %	4.6 %
15-35	4.6 %	4.6 %	4.4 %	4.5 %
36-60	-	5.0 %	4.1 %	5.0 %
61-90	-	4.9 %	4.4 %	4.7 %
91-180	4.3 %	4.6 %	4.3 %	4.4 %
>180	-	4.3 %	4.2 %	4.3 %
<b>Total</b>	<b>4.7 %</b>	<b>4.7 %</b>	<b>4.3 %</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	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	5148	5129	21	116	4595	3780	68	69	3217	3729
<b>Intragruppo y off-shore***</b>	0	0	2615	2136	0	0	2010	2282	0	0	1997	1034
<b>Otros</b>	112	38	1076	1573	116	21	635	1178	69	68	552	1003
<b>Total</b>	<b>149</b>	<b>149</b>	<b>8839</b>	<b>8839</b>	<b>136</b>	<b>136</b>	<b>7239</b>	<b>7239</b>	<b>137</b>	<b>137</b>	<b>5766</b>	<b>5766</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.