

Fecha de Publicación: 20 de junio de 2017

Fecha de Información: 15 de junio de jueves <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\$1331.8 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 5.3%.<sup>2</sup>

**Cuadro No. 1**  
**Contratos Forwards Pactados**

Rango	Sector Financiero**		Intragrupo y Off-shore***		Otros Agentes		Interbancarios
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	291.7	203.1	49.7	135.0	38.4	41.6	115.1
15-35	275.1	404.5	323.9	108.5	23.6	109.6	57.0
36-60	15.3	3.8	0.0	0.0	3.8	15.3	0.0
61-90	8.4	37.1	30.0	0.0	7.1	8.4	0.0
91-180	63.8	44.1	23.0	0.9	11.1	52.9	10.0
>180	76.2	115.8	40.0	42.0	50.8	9.2	25.0
<b>Total</b>	<b>730.4</b>	<b>808.5</b>	<b>466.6</b>	<b>286.4</b>	<b>134.8</b>	<b>236.9</b>	<b>207.1</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	5.6 %	5.8 %	5.5 %	5.6 %
15-35	5.5 %	5.6 %	5.5 %	5.5 %
36-60	-	5.6 %	5.2 %	5.2 %
61-90	-	5.3 %	5.0 %	5.2 %
91-180	4.9 %	4.9 %	4.8 %	4.9 %
>180	4.5 %	4.5 %	4.4 %	4.4 %
<b>Total</b>	-	5.4 %	5.2 %	5.3 %

\* 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	12 al 16 de junio				19 al 23 de junio				26 al 30 de junio			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	23	114	4785	4205	30	91	2666	3044	26	100	3168	3419
Intragrupo y off-shore***	0	0	2438	2375	0	0	1457	744	0	0	1547	1101
Otros	114	23	684	1326	91	30	706	1040	100	26	807	983
<b>Total</b>	<b>137</b>	<b>137</b>	<b>7907</b>	<b>7907</b>	<b>121</b>	<b>121</b>	<b>4828</b>	<b>4828</b>	<b>126</b>	<b>126</b>	<b>5523</b>	<b>5503</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:  $((\text{Tasa Pactada}/\text{Tasa de Contado})^{\frac{360}{\text{Plazo}}}) - 1$ . Para el cálculo de la devaluación implícita se excluyen las operaciones intragrupo.