

**Fecha de Publicación: 22 de junio de 2017**

**Fecha de Información: 20 de junio de martes<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\$2244.2 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 5.6%.<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	310.8	197.7	146.9	174.8	7.7	93.0	43.0
15-35	609.6	1070.3	784.8	100.4	74.6	298.1	211.0
36-60	35.6	10.0	0.0	2.0	10.0	33.6	0.0
61-90	42.3	3.2	0.0	7.5	3.2	34.7	0.0
91-180	96.4	90.7	0.0	0.0	90.7	96.4	0.0
>180	26.4	5.1	0.0	2.7	5.1	23.7	0.0
<b>Total</b>	<b>1121.1</b>	<b>1377.1</b>	<b>931.7</b>	<b>287.4</b>	<b>191.4</b>	<b>579.6</b>	<b>254.0</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 intragrupo		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	5.9 %		6.0 %	5.3 %	5.6 %
15-35	5.9 %		5.9 %	5.5 %	5.8 %
36-60	-		5.6 %	5.0 %	5.1 %
61-90	-		5.6 %	4.8 %	4.9 %
91-180	-		4.8 %	4.6 %	4.7 %
>180	-		5.1 %	3.9 %	4.1 %
<b>Total</b>	<b>5.9 %</b>		<b>5.8 %</b>	<b>5.2 %</b>	<b>5.6 %</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**

Sectores	19 al 23 de junio				26 al 30 de junio				3 al 7 de julio			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	30	90	3047	3197	26	100	3341	3657	4	66	1510	1763
Intragrupo y off-shore***	0	0	1549	1053	0	0	1681	1135	0	0	1001	476
Otros	90	30	726	1072	100	26	860	1070	66	4	342	615
<b>Total</b>	<b>120</b>	<b>120</b>	<b>5322</b>	<b>5322</b>	<b>126</b>	<b>126</b>	<b>5882</b>	<b>5862</b>	<b>70</b>	<b>70</b>	<b>2853</b>	<b>2853</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 intragrupo.