

Fecha de Publicación: 28 de junio de 2017

Fecha de Información: 23 de junio de viernes <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\$1036.9 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 5.3%.<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	136.3	208.9	107.3	26.8	42.7	50.5	59.0
15-35	330.2	306.3	162.5	139.5	82.8	129.7	61.0
36-60	2.4	8.1	0.0	0.0	8.1	2.4	0.0
61-90	1.8	11.8	0.0	0.0	11.8	1.8	0.0
91-180	32.5	32.7	0.0	0.0	22.7	22.5	10.0
>180	31.5	74.4	27.0	20.0	37.4	1.5	10.0
<b>Total</b>	<b>534.7</b>	<b>642.3</b>	<b>296.8</b>	<b>186.3</b>	<b>205.5</b>	<b>208.4</b>	<b>140.0</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	5.6 %	5.7 %	5.3 %	5.5 %
15-35	5.5 %	5.6 %	5.3 %	5.5 %
36-60	-	5.8 %	4.7 %	5.5 %
61-90	-	5.2 %	4.8 %	5.1 %
91-180	4.8 %	5.2 %	4.4 %	4.8 %
>180	4.4 %	4.5 %	4.5 %	4.5 %
<b>Total</b>	<b>5.4 %</b>	<b>5.4 %</b>	<b>5.2 %</b>	<b>5.3 %</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**	27	96	3496	3540	33	108	3639	4106	4	67	1698	1940
Intragruppo y off-shore***	0	0	1614	1468	0	0	1979	1227	0	0	1053	569
Otros	96	27	971	1072	108	33	901	1166	67	4	410	652
<b>Total</b>	<b>124</b>	<b>124</b>	<b>6081</b>	<b>6081</b>	<b>141</b>	<b>141</b>	<b>6519</b>	<b>6499</b>	<b>71</b>	<b>71</b>	<b>3160</b>	<b>3160</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.