

Fecha de Publicación: 6 de julio de 2017

Fecha de Información: 04 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\$156.1 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 4.3%.<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	34.9	5.8	5.3	2.5	0.5	32.4	0.0
15-35	49.4	32.8	31.8	31.6	1.0	17.8	0.0
36-60	2.7	1.4	0.0	0.0	1.4	2.7	0.0
61-90	2.1	0.1	0.0	0.0	0.1	2.1	0.0
91-180	2.9	0.3	0.0	0.0	0.3	2.9	0.0
>180	0.7	23.0	23.0	0.0	0.0	0.7	0.0
<b>Total</b>	<b>92.7</b>	<b>63.4</b>	<b>60.1</b>	<b>34.1</b>	<b>3.3</b>	<b>58.6</b>	<b>0.0</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	-	0.8 %	3.6 %	3.4 %
15-35	-	5.2 %	4.8 %	5.0 %
36-60	-	5.3 %	4.7 %	4.9 %
61-90	-	5.9 %	4.7 %	4.8 %
91-180	-	5.3 %	4.3 %	4.4 %
>180	-	4.2 %	3.0 %	4.2 %
<b>Total</b>	-	4.6 %	4.1 %	4.3 %

\*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	3 al 7 de julio				10 al 14 de julio				17 al 21 de julio			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
<b>Sector Financiero**</b>	23	83	2167	2379	23	85	2616	2931	65	93	2492	3475
<b>Intragrupo y off-shore***</b>	0	0	1243	815	0	0	1507	606	0	0	2228	683
<b>Otros</b>	83	23	503	721	85	23	747	1324	93	65	446	1007
<b>Total</b>	<b>105</b>	<b>105</b>	<b>3914</b>	<b>3914</b>	<b>108</b>	<b>108</b>	<b>4871</b>	<b>4861</b>	<b>158</b>	<b>158</b>	<b>5166</b>	<b>5166</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.