

Fecha de Publicación: 24 de marzo de 2017

Fecha de Información: 22 de marzo de miércoles <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\$1495.2 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 5.7%.<sup>2</sup>

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

Rango	Sector Financiero**		Intragrupa y Off-shore***		Otros Agentes		Interbancarios
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	150.7	127.7	49.0	48.2	28.7	52.5	50.0
15-35	489.5	426.1	227.0	290.9	33.1	32.6	166.0
36-60	15.7	7.8	5.0	0.0	2.8	15.7	0.0
61-90	78.1	98.5	20.0	5.0	78.5	73.1	0.0
91-180	1.3	182.1	2.3	0.0	179.8	1.3	0.0
>180	103.5	100.2	20.0	15.0	10.2	18.5	70.0
<b>Total</b>	<b>838.8</b>	<b>942.4</b>	<b>323.3</b>	<b>359.2</b>	<b>333.1</b>	<b>193.6</b>	<b>286.0</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	6.2 %	5.4 %	5.2 %	5.5 %
15-35	6.0 %	6.1 %	5.8 %	6.0 %
36-60	-	6.7 %	5.0 %	5.6 %
61-90	-	5.3 %	5.1 %	5.2 %
91-180	-	5.6 %	5.2 %	5.6 %
>180	5.1 %	4.9 %	4.9 %	5.0 %
<b>Total</b>	<b>5.8 %</b>	<b>5.7 %</b>	<b>5.4 %</b>	<b>5.7 %</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**

Sector	20 al 24 de marzo				27 al 31 de marzo				3 al 7 de abril			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
<b>Sector Financiero**</b>	18	130	2685	2655	18	200	3079	3069	10	83	2812	2500
<b>Intragrupa y off-shore***</b>	0	0	1337	1095	0	0	1114	765	0	0	1082	1108
<b>Otros</b>	130	18	598	870	200	18	1000	1359	83	10	712	998
<b>Total</b>	<b>148</b>	<b>148</b>	<b>4620</b>	<b>4620</b>	<b>218</b>	<b>218</b>	<b>5193</b>	<b>5193</b>	<b>94</b>	<b>94</b>	<b>4606</b>	<b>4606</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 intragrupo.