

Fecha de Publicación: 27 de marzo de 2017

Fecha de Información: 23 de marzo 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\$1544.1 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 5.5%.<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	202.1	273.2	157.5	14.0	12.7	85.1	103.0
15-35	511.4	423.8	214.0	199.4	25.8	128.0	184.0
36-60	5.9	3.7	0.0	0.0	3.7	5.9	0.0
61-90	20.6	27.3	10.1	0.0	7.3	10.6	10.0
91-180	10.1	200.9	25.1	0.0	165.8	0.1	10.0
>180	157.6	74.4	10.0	45.0	4.4	52.6	60.0
<b>Total</b>	<b>907.7</b>	<b>1003.4</b>	<b>416.7</b>	<b>258.4</b>	<b>219.7</b>	<b>282.3</b>	<b>367.0</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 %	5.6 %	4.0 %	5.3 %
15-35	5.9 %	5.9 %	5.7 %	5.8 %
36-60	-	6.1 %	4.9 %	5.4 %
61-90	5.3 %	5.5 %	5.1 %	5.3 %
91-180	5.3 %	5.6 %	5.1 %	5.6 %
>180	4.8 %	4.9 %	4.8 %	4.8 %
<b>Total</b>	<b>5.7 %</b>	<b>5.7 %</b>	<b>5.1 %</b>	<b>5.5 %</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
Sector Financiero**	18	131	2715	2704	16	200	3232	3284	12	84	2831	2504
Intragrupa y off-shore***	0	0	1368	1105	0	0	1236	765	0	0	1086	1112
Otros	131	18	594	868	200	16	1011	1430	84	12	712	1013
<b>Total</b>	<b>150</b>	<b>150</b>	<b>4677</b>	<b>4677</b>	<b>216</b>	<b>216</b>	<b>5479</b>	<b>5479</b>	<b>96</b>	<b>96</b>	<b>4629</b>	<b>4629</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.