

Fecha de Publicación: 30 de marzo de 2017

Fecha de Información: 28 de marzo 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\$1475.8 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 6.0%.<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	298.6	237.6	99.6	158.9	60.5	62.2	77.5
15-35	573.3	541.8	244.2	166.5	45.0	154.2	252.6
36-60	15.9	14.6	0.4	12.0	14.2	3.9	0.0
61-90	0.9	3.6	0.0	0.0	3.6	0.9	0.0
91-180	33.0	40.0	2.8	20.0	27.2	3.0	10.0
>180	16.5	40.1	0.0	15.4	40.1	1.1	0.0
<b>Total</b>	<b>938.2</b>	<b>877.7</b>	<b>347.0</b>	<b>372.8</b>	<b>190.6</b>	<b>225.3</b>	<b>340.1</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 intragruppo		Total
	Compras/Ventas	Compras	Ventas	
3-14	5.9 %	8.4 %	5.9 %	6.7 %
15-35	5.8 %	5.9 %	5.7 %	5.8 %
36-60	-	5.9 %	5.7 %	5.8 %
61-90	-	5.6 %	5.1 %	5.5 %
91-180	5.1 %	5.3 %	5.1 %	5.2 %
>180	-	5.0 %	4.7 %	5.0 %
<b>Total</b>	<b>5.8 %</b>	<b>6.5 %</b>	<b>5.8 %</b>	<b>6.0 %</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	27 al 31 de marzo				3 al 7 de abril				10 al 14 de abril			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	24	315	3482	3465	15	116	3028	2744	41	73	2720	2823
Intragruppo y off-shore***	0	0	1382	997	0	0	1210	1169	0	0	1264	992
Otros	315	24	973	1375	116	15	752	1077	73	41	598	767
<b>Total</b>	<b>338</b>	<b>338</b>	<b>5837</b>	<b>5837</b>	<b>131</b>	<b>131</b>	<b>4990</b>	<b>4990</b>	<b>115</b>	<b>115</b>	<b>4582</b>	<b>4582</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 intragruppo.