

Fecha de Publicación: 4 de abril de 2017

Fecha de Información: 31 de marzo 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\$1077.0 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 5.2%.<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	65.6	117.0	71.7	31.0	28.3	17.6	17.0
15-35	370.9	303.2	94.5	157.2	140.7	145.7	68.0
36-60	14.9	27.2	0.0	0.0	15.2	2.9	12.0
61-90	45.2	25.5	0.0	0.0	17.5	37.2	8.0
91-180	14.4	63.6	0.0	0.0	50.6	1.4	13.0
>180	115.0	119.1	10.0	20.0	22.6	8.5	86.5
<b>Total</b>	<b>626.0</b>	<b>655.6</b>	<b>176.2</b>	<b>208.2</b>	<b>274.9</b>	<b>213.3</b>	<b>204.5</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	5.1 %	6.4 %	4.5 %	5.8 %
15-35	5.3 %	5.4 %	5.1 %	5.3 %
36-60	5.0 %	5.7 %	4.9 %	5.3 %
61-90	5.7 %	5.6 %	4.9 %	5.2 %
91-180	5.0 %	5.2 %	4.8 %	5.1 %
>180	4.8 %	5.0 %	4.7 %	4.8 %
<b>Total</b>	<b>5.0 %</b>	<b>5.5 %</b>	<b>5.0 %</b>	<b>5.2 %</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	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**	26	303	3712	3524	20	124	3340	3018	45	78	2783	2921
Intragrupa y off-shore***	0	0	1403	1192	0	0	1314	1304	0	0	1300	992
Otros	303	26	989	1388	124	20	782	1114	78	45	609	780
<b>Total</b>	<b>329</b>	<b>329</b>	<b>6104</b>	<b>6104</b>	<b>144</b>	<b>144</b>	<b>5436</b>	<b>5436</b>	<b>123</b>	<b>123</b>	<b>4692</b>	<b>4692</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.