

Fecha de Publicación: 6 de abril de 2017

Fecha de Información: 04 de abril 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\$1334.5 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 5.4%.<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	218.2	143.9	44.0	133.3	23.4	8.4	76.5
15-35	464.8	401.8	195.5	197.1	111.8	173.2	94.5
36-60	16.2	20.3	0.0	0.0	5.3	1.2	15.0
61-90	31.6	7.6	0.0	30.0	7.6	1.6	0.0
91-180	18.8	19.1	0.0	16.0	19.1	2.8	0.0
>180	83.5	148.3	64.0	10.0	30.8	20.0	53.5
<b>Total</b>	<b>833.1</b>	<b>740.9</b>	<b>303.5</b>	<b>386.4</b>	<b>197.9</b>	<b>207.2</b>	<b>239.5</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	5.5 %	6.0 %	5.8 %	5.7 %
15-35	5.5 %	5.3 %	5.6 %	5.4 %
36-60	5.3 %	5.7 %	5.0 %	5.4 %
61-90	-	5.3 %	5.1 %	5.2 %
91-180	-	5.3 %	5.0 %	5.1 %
>180	4.8 %	4.9 %	4.7 %	4.8 %
<b>Total</b>	<b>5.3 %</b>	<b>5.3 %</b>	<b>5.5 %</b>	<b>5.4 %</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	3 al 7 de abril				10 al 14 de abril				17 al 21 de abril			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	27	122	3641	3195	45	78	2916	3025	47	152	3554	2563
Intragrupa y off-shore***	0	0	1392	1476	0	0	1305	1062	0	0	1128	1399
Otros	122	27	781	1143	78	45	649	784	152	47	784	1505
<b>Total</b>	<b>149</b>	<b>149</b>	<b>5814</b>	<b>5814</b>	<b>124</b>	<b>124</b>	<b>4871</b>	<b>4871</b>	<b>200</b>	<b>200</b>	<b>5467</b>	<b>5467</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.