

Fecha de Publicación: 7 de abril de 2017

Fecha de Información: 05 de abril 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\$1232.0 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 5.3%.<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	107.4	106.8	100.5	101.0	6.3	6.4	0.0
15-35	400.9	358.2	218.0	177.8	52.5	135.4	87.7
36-60	9.7	15.6	0.0	5.6	15.5	4.2	0.0
61-90	2.6	11.3	0.0	0.0	11.3	2.6	0.0
91-180	80.5	32.1	0.0	80.0	32.1	0.5	0.0
>180	145.6	115.1	25.0	53.0	24.1	26.6	66.0
<b>Total</b>	<b>746.7</b>	<b>639.1</b>	<b>343.5</b>	<b>417.3</b>	<b>141.8</b>	<b>175.6</b>	<b>153.7</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	-	6.3 %	5.1 %	5.9 %
15-35	5.3 %	5.4 %	5.2 %	5.3 %
36-60	-	5.7 %	4.6 %	5.5 %
61-90	-	6.2 %	5.2 %	6.0 %
91-180	-	5.5 %	5.1 %	5.2 %
>180	4.8 %	4.9 %	4.7 %	4.8 %
<b>Total</b>	<b>5.1 %</b>	<b>5.6 %</b>	<b>5.1 %</b>	<b>5.3 %</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	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	120	3691	3258	45	78	2927	3058	47	152	3627	2592
Intragruppo y off-shore***	0	0	1453	1523	0	0	1337	1072	0	0	1152	1443
Otros	120	27	783	1146	78	45	651	785	152	47	790	1533
<b>Total</b>	<b>147</b>	<b>147</b>	<b>5927</b>	<b>5927</b>	<b>123</b>	<b>123</b>	<b>4915</b>	<b>4915</b>	<b>199</b>	<b>199</b>	<b>5569</b>	<b>5569</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.