

Fecha de Publicación: 17 de abril de 2017

Fecha de Información: 11 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\$1724.6 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 5.1%.<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	63.6	221.9	156.5	7.8	24.4	14.9	41.0
15-35	617.4	651.5	294.9	175.0	222.5	308.4	134.0
36-60	21.0	24.4	0.0	0.0	4.4	1.0	20.0
61-90	38.6	15.9	0.0	20.0	15.9	18.6	0.0
91-180	13.0	6.5	0.0	10.0	6.5	3.0	0.0
>180	179.1	151.5	25.0	20.0	41.5	74.1	85.0
<b>Total</b>	<b>932.7</b>	<b>1071.8</b>	<b>476.4</b>	<b>232.8</b>	<b>315.4</b>	<b>420.0</b>	<b>280.0</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 intragruppo		Total
	Compras/Ventas	Compras	Ventas	
3-14	5.4 %	5.2 %	3.7 %	5.1 %
15-35	5.2 %	5.3 %	5.1 %	5.2 %
36-60	5.0 %	5.8 %	4.9 %	5.2 %
61-90	-	5.4 %	5.1 %	5.2 %
91-180	-	5.5 %	5.0 %	5.1 %
>180	4.8 %	5.1 %	4.6 %	4.8 %
<b>Total</b>	<b>5.1 %</b>	<b>5.3 %</b>	<b>5.0 %</b>	<b>5.1 %</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	10 al 14 de abril				17 al 21 de abril				24 al 28 de abril			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
<b>Sector Financiero**</b>	30	72	3317	3331	73	160	3937	3110	65	167	3088	2651
<b>Intragruppo y off-shore***</b>	0	0	1496	1345	0	0	1499	1566	0	0	1161	1416
<b>Otros</b>	72	30	666	802	160	73	841	1600	167	65	815	997
<b>Total</b>	<b>102</b>	<b>102</b>	<b>5478</b>	<b>5478</b>	<b>233</b>	<b>233</b>	<b>6277</b>	<b>6277</b>	<b>232</b>	<b>232</b>	<b>5064</b>	<b>5064</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: ((Tasa Pactada/Tasa de Contado) ^ (360/Plazo)) - 1. Para el cálculo de la devaluación implícita se excluyen las operaciones intragruppo.