

Fecha de Publicación: 20 de abril de 2017

Fecha de Información: 18 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\$2127.3 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	241.7	270.2	127.5	109.5	46.7	36.2	96.0
15-35	927.0	508.7	143.5	433.0	191.7	320.5	173.5
36-60	10.9	45.9	20.1	7.5	25.8	3.4	0.0
61-90	23.7	51.1	0.0	0.0	51.1	23.7	0.0
91-180	42.7	93.1	0.2	10.0	62.9	2.7	30.0
>180	123.9	139.2	10.0	50.1	78.2	22.8	51.0
<b>Total</b>	<b>1369.8</b>	<b>1108.0</b>	<b>301.3</b>	<b>610.1</b>	<b>456.2</b>	<b>409.2</b>	<b>350.5</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	5.7 %	6.1 %	4.9 %	5.6 %
15-35	5.7 %	5.6 %	5.4 %	5.5 %
36-60	-	5.9 %	0.6 %	5.5 %
61-90	-	5.6 %	4.6 %	5.3 %
91-180	5.3 %	5.6 %	3.0 %	5.2 %
>180	4.8 %	5.3 %	3.4 %	4.5 %
<b>Total</b>	<b>5.5 %</b>	<b>5.7 %</b>	<b>5.1 %</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	17 al 21 de abril				24 al 28 de abril				1 al 5 de mayo			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	73	160	4207	3576	67	169	3256	2953	6	84	2008	1736
Intragrupa y off-shore***	0	0	1834	1678	0	0	1265	1447	0	0	747	794
Otros	160	73	871	1657	169	67	915	1037	84	6	380	605
<b>Total</b>	<b>234</b>	<b>234</b>	<b>6912</b>	<b>6912</b>	<b>236</b>	<b>236</b>	<b>5436</b>	<b>5436</b>	<b>90</b>	<b>90</b>	<b>3135</b>	<b>3135</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.