

Fecha de Publicación: 25 de abril de 2017

Fecha de Información: 21 de abril 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\$920.7 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 5.5%.<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	49.1	87.3	64.5	11.0	12.8	28.1	10.0
15-35	355.9	432.7	236.0	41.5	50.7	168.4	146.0
36-60	4.0	7.7	3.8	0.0	4.0	4.0	0.0
61-90	66.3	7.0	0.0	60.0	7.0	6.3	0.0
91-180	2.5	16.1	0.0	0.0	14.1	0.5	2.0
>180	43.4	21.7	5.0	5.0	1.7	23.4	15.0
<b>Total</b>	<b>521.2</b>	<b>572.5</b>	<b>309.3</b>	<b>117.5</b>	<b>90.3</b>	<b>230.7</b>	<b>173.0</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	5.8 %	5.8 %	4.6 %	5.4 %
15-35	5.7 %	5.7 %	5.5 %	5.6 %
36-60	-	5.6 %	5.1 %	5.4 %
61-90	-	6.0 %	5.5 %	5.6 %
91-180	5.1 %	5.6 %	4.9 %	5.6 %
>180	4.7 %	5.1 %	4.7 %	4.8 %
<b>Total</b>	<b>5.6 %</b>	<b>5.7 %</b>	<b>5.3 %</b>	<b>5.5 %</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	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**	77	143	4339	3658	73	168	3422	3182	6	84	2163	1984
Intragruppo y off-shore***	0	0	1910	1805	0	0	1355	1474	0	0	867	816
Otros	143	77	878	1663	168	73	992	1113	84	6	389	619
<b>Total</b>	<b>220</b>	<b>220</b>	<b>7126</b>	<b>7126</b>	<b>241</b>	<b>241</b>	<b>5769</b>	<b>5769</b>	<b>91</b>	<b>91</b>	<b>3419</b>	<b>3419</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.