

**Fecha de Publicación: 2 de mayo de 2017**

**Fecha de Información: 27 de abril de jueves<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\$1754.8 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 5.5%.<sup>2</sup>

**Cuadro No. 1**  
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero**		Intragrupo y Off-shore***		Otros Agentes		Interbancarios
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	364.6	148.9	45.0	198.0	18.8	81.5	85.1
15-35	478.2	833.4	462.8	74.8	103.1	135.9	267.5
36-60	14.9	12.1	10.0	0.0	2.1	14.9	0.0
61-90	100.2	84.7	0.0	0.0	84.7	100.2	0.0
91-180	8.8	11.3	0.4	0.0	10.9	8.8	0.0
>180	48.6	36.8	0.0	4.0	1.8	9.6	35.0
<b>Total</b>	<b>1015.2</b>	<b>1127.2</b>	<b>518.2</b>	<b>276.8</b>	<b>221.4</b>	<b>350.8</b>	<b>387.6</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	5.8 %		8.4 %	4.2 %	5.6 %
15-35	4.8 %		6.0 %	5.6 %	5.5 %
36-60	-		5.8 %	5.3 %	5.5 %
61-90	-		5.2 %	5.1 %	5.1 %
91-180	-		5.3 %	5.0 %	5.2 %
>180	4.6 %		5.1 %	4.4 %	4.6 %
<b>Total</b>	<b>5.0 %</b>		<b>6.1 %</b>	<b>5.0 %</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

Sectores	24 al 28 de abril				1 al 5 de mayo				8 al 12 de mayo			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	76	167	3911	3563	8	87	3200	2276	29	98	2208	2048
Intragrupo y off-shore***	0	0	1619	1746	0	0	979	855	0	0	848	735
Otros	167	76	995	1215	87	8	490	1538	98	29	575	847
<b>Total</b>	<b>243</b>	<b>243</b>	<b>6525</b>	<b>6525</b>	<b>94</b>	<b>94</b>	<b>4669</b>	<b>4669</b>	<b>127</b>	<b>127</b>	<b>3631</b>	<b>3631</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 intragrupo.