

Fecha de Publicación: 5 de mayo de 2017

Fecha de Información: 03 de mayo 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\$1476.7 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 5.7%.<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	321.1	226.5	63.7	143.0	16.0	31.4	146.8
15-35	630.9	448.2	219.5	120.7	17.4	298.9	211.3
36-60	7.0	6.0	1.6	0.0	4.4	7.0	0.0
61-90	62.3	75.8	0.0	0.0	75.8	62.3	0.0
91-180	10.0	44.0	0.0	0.0	34.0	0.0	10.0
>180	7.2	5.6	0.0	0.0	5.6	7.2	0.0
<b>Total</b>	<b>1038.5</b>	<b>806.1</b>	<b>284.8</b>	<b>263.7</b>	<b>153.3</b>	<b>406.8</b>	<b>368.0</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 intragrupo		Total
	Compras/Ventas	Compras	Ventas	
3-14	6.4 %	6.8 %	5.6 %	6.2 %
15-35	5.8 %	5.7 %	5.6 %	5.7 %
36-60	-	5.8 %	5.4 %	5.6 %
61-90	-	5.2 %	5.0 %	5.1 %
91-180	5.1 %	5.4 %	4.4 %	5.3 %
>180	-	4.8 %	4.2 %	4.5 %
<b>Total</b>	<b>6.0 %</b>	<b>5.8 %</b>	<b>5.5 %</b>	<b>5.7 %</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	1 al 5 de mayo				8 al 12 de mayo				15 al 19 de mayo			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
<b>Sector Financiero**</b>	12	82	3612	2510	31	99	2467	2289	43	150	3125	2588
<b>Intragrupo y off-shore***</b>	0	0	1076	1106	0	0	943	789	0	0	1116	1105
<b>Otros</b>	82	12	502	1573	99	31	629	961	150	43	849	1397
<b>Total</b>	<b>94</b>	<b>94</b>	<b>5190</b>	<b>5190</b>	<b>130</b>	<b>130</b>	<b>4039</b>	<b>4039</b>	<b>193</b>	<b>193</b>	<b>5090</b>	<b>5090</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:  $((\text{Tasa Pactada}/\text{Tasa de Contado})^{\frac{360}{\text{Plazo}}}) - 1$ . Para el cálculo de la devaluación implícita se excluyen las operaciones intragrupo.