

**Fecha de Publicación: 8 de mayo de 2017**

**Fecha de Información: 04 de mayo 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\$1582.9 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 5.6%.<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	222.1	175.8	87.0	133.2	56.8	56.9	32.0
15-35	484.4	685.6	475.2	97.5	60.6	237.0	149.8
36-60	9.8	11.8	10.8	0.0	0.9	9.8	0.0
61-90	22.9	14.8	0.0	0.0	9.8	17.9	5.0
91-180	26.0	89.4	46.0	0.0	22.4	5.0	21.0
>180	18.7	29.5	20.0	10.0	9.5	8.7	0.0
<b>Total</b>	<b>783.9</b>	<b>1006.8</b>	<b>639.0</b>	<b>240.7</b>	<b>160.0</b>	<b>335.3</b>	<b>207.8</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	
3-14	5.5 %	5.8 %	5.5 %	5.6 %
15-35	5.8 %	5.7 %	5.5 %	5.6 %
36-60	-	6.3 %	5.3 %	5.4 %
61-90	5.4 %	5.4 %	5.0 %	5.2 %
91-180	5.2 %	5.2 %	4.8 %	5.1 %
>180	-	4.4 %	4.3 %	4.3 %
<b>Total</b>	<b>5.7 %</b>	<b>5.6 %</b>	<b>5.4 %</b>	<b>5.6 %</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
Sector Financiero**	12	83	3701	2525	42	99	2558	2363	43	150	3179	2694
Intragrupo y off-shore***	0	0	1095	1201	0	0	981	827	0	0	1146	1105
Otros	83	12	497	1567	99	42	645	994	150	43	893	1419
<b>Total</b>	<b>95</b>	<b>95</b>	<b>5293</b>	<b>5293</b>	<b>141</b>	<b>141</b>	<b>4184</b>	<b>4184</b>	<b>193</b>	<b>193</b>	<b>5218</b>	<b>5218</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.