

**Fecha de Publicación: 10 de mayo de 2017**

**Fecha de Información: 08 de mayo de lunes <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\$1168.8 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	150.3	270.7	156.8	45.5	41.0	31.8	73.0
15-35	371.7	344.6	150.8	90.5	125.4	212.7	68.5
36-60	10.4	15.9	10.9	0.0	5.0	10.4	0.0
61-90	22.2	7.2	0.0	0.0	7.2	22.2	0.0
91-180	42.8	30.1	10.0	40.0	20.1	2.8	0.0
>180	35.1	24.4	7.2	10.0	2.2	10.1	15.0
<b>Total</b>	<b>632.5</b>	<b>692.9</b>	<b>335.6</b>	<b>186.0</b>	<b>200.8</b>	<b>290.0</b>	<b>156.5</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	5.9 %	6.0 %	5.8 %	5.9 %
15-35	5.8 %	5.8 %	5.7 %	5.8 %
36-60	-	6.3 %	5.2 %	5.6 %
61-90	-	6.0 %	5.2 %	5.4 %
91-180	-	5.2 %	5.3 %	5.3 %
>180	4.6 %	5.2 %	4.4 %	4.6 %
<b>Total</b>	<b>5.7 %</b>	<b>5.8 %</b>	<b>5.6 %</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	8 al 12 de mayo				15 al 19 de mayo				22 al 26 de mayo			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	54	109	2858	2658	43	152	3317	2917	24	142	2335	2796
Intragrupo y off-shore***	0	0	1149	996	0	0	1252	1140	0	0	1549	695
Otros	109	54	677	1031	152	43	916	1428	142	24	583	977
<b>Total</b>	<b>163</b>	<b>163</b>	<b>4684</b>	<b>4684</b>	<b>195</b>	<b>195</b>	<b>5485</b>	<b>5485</b>	<b>166</b>	<b>166</b>	<b>4468</b>	<b>4468</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.