

**Fecha de Publicación: 12 de mayo de 2017**

**Fecha de Información: 10 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\$1150.8 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 5.9%.<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	261.8	209.5	40.3	112.3	51.2	31.5	118.0
15-35	498.1	507.7	219.1	145.0	22.1	86.6	266.5
36-60	0.5	3.0	0.0	0.0	3.0	0.5	0.0
61-90	3.4	3.7	0.0	0.0	3.7	3.4	0.0
91-180	10.5	16.8	0.0	10.0	16.8	0.5	0.0
>180	16.1	16.5	0.0	0.0	4.5	4.1	12.0
<b>Total</b>	<b>790.3</b>	<b>757.0</b>	<b>259.4</b>	<b>267.3</b>	<b>101.2</b>	<b>126.6</b>	<b>396.5</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 intragruppo		Total
	Compras/Ventas	Compras	Ventas	
3-14	5.8 %	6.3 %	6.0 %	6.0 %
15-35	5.8 %	6.0 %	5.8 %	5.9 %
36-60	-	7.8 %	5.2 %	7.5 %
61-90	-	5.8 %	5.3 %	5.5 %
91-180	-	5.2 %	5.3 %	5.2 %
>180	4.5 %	4.9 %	4.4 %	4.6 %
<b>Total</b>	<b>5.7 %</b>	<b>6.1 %</b>	<b>5.8 %</b>	<b>5.9 %</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	114	2961	2798	44	153	3484	3093	24	144	2547	3088
Intragruppo y off-shore***	0	0	1240	1060	0	0	1296	1206	0	0	1679	701
Otros	114	54	706	1049	153	44	976	1457	143	24	619	1056
<b>Total</b>	<b>168</b>	<b>168</b>	<b>4907</b>	<b>4907</b>	<b>196</b>	<b>196</b>	<b>5756</b>	<b>5756</b>	<b>168</b>	<b>168</b>	<b>4845</b>	<b>4845</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 intragruppo.