

Fecha de Publicación: 22 de mayo de 2017

Fecha de Información: 18 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\$1594.3 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 6.1%.<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	284.4	141.7	96.0	249.7	45.7	34.7	0.0
15-35	483.7	657.1	492.3	185.0	82.8	216.7	82.0
36-60	8.6	8.8	0.0	0.0	8.8	8.6	0.0
61-90	18.1	19.6	0.0	0.0	19.6	18.1	0.0
91-180	11.5	29.9	10.0	0.0	9.9	1.5	10.0
>180	22.1	10.7	0.0	0.0	0.7	12.1	10.0
<b>Total</b>	<b>828.5</b>	<b>867.9</b>	<b>598.3</b>	<b>434.7</b>	<b>167.6</b>	<b>291.8</b>	<b>102.0</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	-	5.8 %	5.7 %	5.7 %
15-35	6.3 %	6.5 %	6.0 %	6.3 %
36-60	-	6.2 %	5.2 %	5.7 %
61-90	-	5.7 %	5.4 %	5.5 %
91-180	5.6 %	5.7 %	4.7 %	5.6 %
>180	4.6 %	5.5 %	4.4 %	4.5 %
<b>Total</b>	<b>6.1 %</b>	<b>6.3 %</b>	<b>5.8 %</b>	<b>6.1 %</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	15 al 19 de mayo				22 al 26 de mayo				29 de may. al 2 de junio			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
<b>Sector Financiero**</b>	47	147	3835	3777	17	194	3270	3690	13	90	2029	2511
<b>Intragrupo y off-shore***</b>	0	0	1755	1394	0	0	1877	1054	0	0	1255	503
<b>Otros</b>	147	47	1032	1452	194	17	788	1192	90	13	481	751
<b>Total</b>	<b>194</b>	<b>194</b>	<b>6622</b>	<b>6622</b>	<b>212</b>	<b>212</b>	<b>5935</b>	<b>5935</b>	<b>103</b>	<b>103</b>	<b>3765</b>	<b>3765</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.