

Fecha de Publicación: 1 de febrero de 2017

Fecha de Información: 30 de enero 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\$972.1 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 5.9%.<sup>2</sup>

Cuadro No. 1  
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero**		Intragrupa y Off-shore***		Otros Agentes		Interbancarios
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	87.5	50.5	9.3	32.9	14.2	27.6	27.0
15-35	285.5	289.1	88.0	116.9	135.1	102.6	66.0
36-60	15.3	32.5	28.5	0.0	4.0	15.3	0.0
61-90	0.1	22.7	10.0	0.0	12.7	0.1	0.0
91-180	68.5	159.2	30.0	10.0	124.2	53.5	5.0
>180	36.0	28.1	0.0	0.0	23.1	31.0	5.0
<b>Total</b>	<b>492.9</b>	<b>582.2</b>	<b>165.8</b>	<b>159.8</b>	<b>313.4</b>	<b>230.1</b>	<b>103.0</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	6.5 %	6.4 %	5.6 %	6.1 %
15-35	6.3 %	5.8 %	6.1 %	6.0 %
36-60	-	6.5 %	5.5 %	6.0 %
61-90	-	6.4 %	6.1 %	6.4 %
91-180	5.7 %	5.9 %	5.6 %	5.8 %
>180	5.6 %	5.6 %	5.5 %	5.6 %
<b>Total</b>	<b>6.3 %</b>	<b>5.9 %</b>	<b>5.9 %</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.

<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.

**Cuadro No. 3**  
**Vencimientos de Forwards**

Sectores	30 de ene. al 3 de febrero				6 al 10 de febrero				13 al 17 de febrero			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
<b>Sector Financiero**</b>	12	88	2931	2827	11	83	2282	2224	11	117	2902	2371
<b>Intragruppo y off-shore***</b>	0	0	1036	974	0	0	861	788	0	0	977	1141
<b>Otros</b>	88	12	845	1010	83	11	799	905	117	11	734	1101
<b>Total</b>	<b>100</b>	<b>100</b>	<b>4811</b>	<b>4811</b>	<b>94</b>	<b>94</b>	<b>3942</b>	<b>3917</b>	<b>127</b>	<b>127</b>	<b>4613</b>	<b>4613</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.