

Fecha de Publicación: 6 de febrero de 2017

Fecha de Información: 02 de febrero 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\$1750.2 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	307.8	160.6	31.2	141.5	36.4	73.3	93.0
15-35	599.9	518.1	276.7	312.8	127.8	173.6	113.6
36-60	3.9	21.8	0.1	0.0	21.8	3.9	0.0
61-90	1.1	29.9	3.0	0.2	26.9	0.9	0.0
91-180	109.3	128.6	0.0	45.0	123.6	59.3	5.0
>180	44.7	46.1	10.1	34.5	26.0	0.2	10.0
<b>Total</b>	<b>1066.7</b>	<b>905.1</b>	<b>321.0</b>	<b>534.0</b>	<b>362.5</b>	<b>311.1</b>	<b>221.6</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	4.0 %	6.4 %	6.2 %	5.7 %
15-35	6.0 %	6.2 %	5.7 %	6.0 %
36-60	-	6.8 %	5.3 %	6.6 %
61-90	-	6.7 %	5.6 %	6.7 %
91-180	6.1 %	6.0 %	5.9 %	6.0 %
>180	5.4 %	6.0 %	5.7 %	5.8 %
<b>Total</b>	<b>5.1 %</b>	<b>6.2 %</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**

Sector	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>	13	86	3269	2887	11	100	2651	2381	11	124	3156	2669
<b>Intragruppo y off-shore***</b>	0	0	1124	1280	0	0	880	980	0	0	1068	1199
<b>Otros</b>	86	13	794	1019	99	11	822	968	124	11	790	1145
<b>Total</b>	<b>99</b>	<b>99</b>	<b>5187</b>	<b>5187</b>	<b>111</b>	<b>111</b>	<b>4354</b>	<b>4329</b>	<b>134</b>	<b>134</b>	<b>5013</b>	<b>5013</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.