

Fecha de Publicación: 7 de febrero de 2017

Fecha de Información: 03 de febrero de viernes <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\$1453.7 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 6.2%.<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	189.8	228.3	62.5	18.5	30.8	36.3	135.0
15-35	649.9	371.8	134.5	354.6	98.1	156.1	139.3
36-60	0.6	28.2	0.0	0.0	28.2	0.6	0.0
61-90	110.6	73.4	30.0	90.0	23.4	0.6	20.0
91-180	3.1	59.4	0.0	0.0	59.4	3.1	0.0
>180	12.8	27.1	0.0	0.0	20.1	5.8	7.0
<b>Total</b>	<b>966.8</b>	<b>788.2</b>	<b>227.0</b>	<b>463.1</b>	<b>259.9</b>	<b>202.5</b>	<b>301.3</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	6.6 %	6.7 %	5.8 %	6.4 %
15-35	6.2 %	6.4 %	5.9 %	6.1 %
36-60	-	7.0 %	5.9 %	7.0 %
61-90	6.0 %	6.1 %	6.1 %	6.1 %
91-180	-	6.4 %	5.7 %	6.4 %
>180	5.7 %	6.6 %	5.2 %	6.2 %
<b>Total</b>	<b>6.2 %</b>	<b>6.5 %</b>	<b>5.9 %</b>	<b>6.2 %</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: ((Tasa Pactada/Tasa de Contado) ^ (360/Plazo)) - 1. Para el cálculo de la devaluación implícita se excluyen las operaciones intragruppo.

**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>	13	86	3270	2887	11	101	2702	2451	11	131	3297	2819
<b>Intragruppo y off-shore***</b>	0	0	1124	1280	0	0	924	996	0	0	1087	1202
<b>Otros</b>	86	13	794	1020	101	11	834	988	130	11	800	1164
<b>Total</b>	<b>99</b>	<b>99</b>	<b>5188</b>	<b>5188</b>	<b>113</b>	<b>113</b>	<b>4460</b>	<b>4435</b>	<b>141</b>	<b>141</b>	<b>5184</b>	<b>5184</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.