

Fecha de Publicación: 15 de marzo de 2017

Fecha de Información: 13 de marzo 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\$1239.5 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 6.1%.<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	138.1	219.5	154.9	56.9	4.6	21.2	60.0
15-35	513.5	421.2	131.1	165.3	169.8	227.9	120.4
36-60	7.2	21.1	5.0	0.0	16.1	7.2	0.0
61-90	37.7	1.0	0.0	31.6	1.0	6.1	0.0
91-180	1.6	19.3	0.0	0.0	19.3	1.6	0.0
>180	28.8	10.8	10.0	0.0	0.8	28.8	0.0
<b>Total</b>	<b>726.9</b>	<b>693.0</b>	<b>301.0</b>	<b>253.8</b>	<b>211.6</b>	<b>292.7</b>	<b>180.4</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	6.3 %	6.2 %	5.6 %	6.1 %
15-35	6.0 %	6.4 %	6.1 %	6.2 %
36-60	-	6.0 %	4.9 %	5.7 %
61-90	-	5.7 %	5.2 %	5.3 %
91-180	-	5.3 %	4.9 %	5.3 %
>180	-	5.1 %	4.8 %	4.9 %
<b>Total</b>	<b>6.1 %</b>	<b>6.3 %</b>	<b>5.9 %</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

Sector	13 al 17 de marzo												20 al 24 de marzo				27 al 31 de marzo			
	Delivery				NDF				Delivery		NDF		Delivery		NDF					
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V						
<b>Sector Financiero**</b>	44	130	4041	4204	15	128	2120	2009	11	137	2727	2409								
<b>Intragrupa y off-shore***</b>	0	0	2063	1472	0	0	1019	870	0	0	800	680								
<b>Otros</b>	130	44	1076	1505	128	15	550	810	137	11	832	1270								
<b>Total</b>	<b>174</b>	<b>174</b>	<b>7180</b>	<b>7180</b>	<b>143</b>	<b>143</b>	<b>3689</b>	<b>3689</b>	<b>148</b>	<b>148</b>	<b>4359</b>	<b>4359</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.