

Fecha de Publicación: 16 de marzo de 2017

Fecha de Información: 14 de marzo de martes <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\$1634.1 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 6.0%.<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	287.2	311.6	152.5	107.3	5.1	25.9	154.0
15-35	598.5	577.8	238.8	116.3	124.0	267.2	215.0
36-60	12.4	23.8	0.0	0.0	13.8	2.4	10.0
61-90	4.0	48.8	15.0	0.0	33.9	4.0	0.0
91-180	67.5	16.2	0.0	60.0	16.2	7.5	0.0
>180	62.7	12.6	0.0	49.5	2.6	3.2	10.0
<b>Total</b>	<b>1032.2</b>	<b>990.9</b>	<b>406.3</b>	<b>333.1</b>	<b>195.6</b>	<b>310.1</b>	<b>389.0</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 %	6.0 %	6.2 %	6.0 %
15-35	6.2 %	6.4 %	6.1 %	6.2 %
36-60	5.4 %	6.1 %	4.9 %	5.7 %
61-90	-	5.5 %	5.1 %	5.5 %
91-180	-	5.1 %	5.1 %	5.1 %
>180	4.8 %	6.1 %	4.8 %	4.9 %
<b>Total</b>	<b>6.0 %</b>	<b>6.2 %</b>	<b>5.9 %</b>	<b>6.0 %</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
Sector Financiero**	44	131	4177	4321	15	128	2250	2178	11	138	2785	2488
Intragrupa y off-shore***	0	0	2104	1524	0	0	1130	925	0	0	821	680
Otros	131	44	1072	1508	128	15	553	830	138	11	836	1274
<b>Total</b>	<b>176</b>	<b>176</b>	<b>7353</b>	<b>7353</b>	<b>144</b>	<b>144</b>	<b>3933</b>	<b>3933</b>	<b>149</b>	<b>149</b>	<b>4442</b>	<b>4442</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.