

Fecha de Publicación: 22 de marzo de 2017

Fecha de Información: 17 de marzo 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\$1484.0 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 5.6%.<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	127.6	194.5	103.4	49.0	20.1	7.6	71.0
15-35	592.5	322.1	182.6	317.6	82.5	217.9	57.0
36-60	18.0	8.0	0.0	12.0	8.0	6.0	0.0
61-90	1.3	24.4	0.0	0.0	24.4	1.3	0.0
91-180	0.1	156.1	0.0	0.0	156.1	0.1	0.0
>180	87.1	113.4	1.4	20.0	79.0	34.1	33.0
<b>Total</b>	<b>826.5</b>	<b>818.5</b>	<b>287.3</b>	<b>398.6</b>	<b>370.2</b>	<b>266.9</b>	<b>161.0</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	5.4 %	5.8 %	5.2 %	5.5 %
15-35	5.6 %	5.9 %	5.5 %	5.7 %
36-60	-	6.0 %	5.3 %	5.5 %
61-90	-	5.8 %	5.1 %	5.8 %
91-180	-	5.7 %	4.5 %	5.7 %
>180	5.0 %	5.0 %	4.8 %	5.0 %
<b>Total</b>	<b>5.4 %</b>	<b>5.7 %</b>	<b>5.4 %</b>	<b>5.6 %</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**	41	125	4523	4385	20	132	2465	2400	12	146	2890	2928
Intragrupa y off-shore***	0	0	2115	1808	0	0	1228	1009	0	0	1049	723
Otros	125	41	1064	1509	132	20	581	865	146	12	1004	1291
<b>Total</b>	<b>167</b>	<b>167</b>	<b>7702</b>	<b>7702</b>	<b>152</b>	<b>152</b>	<b>4274</b>	<b>4274</b>	<b>158</b>	<b>158</b>	<b>4943</b>	<b>4943</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.