

Fecha de Publicación: 14 de febrero de 2017

Fecha de Información: 10 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\$1186.0 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	125.3	183.8	103.0	65.3	42.8	22.1	38.0
15-35	376.5	353.2	199.2	228.5	29.7	23.7	124.3
36-60	66.9	5.4	0.0	53.0	5.4	13.9	0.0
61-90	1.3	35.6	23.0	0.0	12.6	1.3	0.0
91-180	41.8	61.4	0.0	0.0	61.3	41.8	0.0
>180	81.1	46.1	5.0	30.0	11.1	21.1	30.0
<b>Total</b>	<b>692.9</b>	<b>685.4</b>	<b>330.3</b>	<b>376.8</b>	<b>162.8</b>	<b>123.8</b>	<b>192.3</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	6.5 %	6.8 %	6.1 %	6.5 %
15-35	6.3 %	6.4 %	6.2 %	6.3 %
36-60	-	7.0 %	6.1 %	6.2 %
61-90	-	6.4 %	5.9 %	6.3 %
91-180	-	5.9 %	5.7 %	5.8 %
>180	5.7 %	5.9 %	1.8 %	4.2 %
<b>Total</b>	<b>6.3 %</b>	<b>6.5 %</b>	<b>5.8 %</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.

**Cuadro No. 3**  
**Vencimientos de Forwards**

Sector	6 al 10 de febrero				13 al 17 de febrero				20 al 24 de febrero			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
<b>Sector Financiero**</b>	11	92	3042	2700	21	138	3708	3341	22	135	2688	2729
<b>Intragruppo y off-shore***</b>	0	0	1098	1239	0	0	1364	1372	0	0	1347	1096
<b>Otros</b>	92	11	841	1017	138	21	887	1246	135	22	859	1064
<b>Total</b>	<b>103</b>	<b>103</b>	<b>4980</b>	<b>4955</b>	<b>159</b>	<b>159</b>	<b>5959</b>	<b>5959</b>	<b>156</b>	<b>156</b>	<b>4894</b>	<b>4889</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 intragruppo.