

Fecha de Publicación: 15 de febrero de 2017

Fecha de Información: 13 de febrero 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\$1276.5 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 6.4%.<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	175.4	292.2	181.3	49.0	7.0	22.4	104.0
15-35	393.7	352.7	208.3	182.5	81.4	148.2	63.0
36-60	18.4	6.0	4.5	10.0	1.5	8.4	0.0
61-90	30.9	16.1	0.0	30.0	16.1	0.9	0.0
91-180	108.9	62.7	0.0	10.0	32.7	68.9	30.0
>180	10.2	6.3	0.0	0.0	6.3	10.2	0.0
<b>Total</b>	<b>737.5</b>	<b>735.9</b>	<b>394.0</b>	<b>281.5</b>	<b>144.9</b>	<b>259.0</b>	<b>197.0</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	6.6 %	7.0 %	6.1 %	6.7 %
15-35	6.3 %	6.5 %	6.3 %	6.4 %
36-60	-	7.3 %	6.3 %	6.4 %
61-90	-	6.6 %	6.3 %	6.4 %
91-180	6.1 %	6.2 %	5.9 %	6.0 %
>180	-	6.0 %	5.7 %	5.8 %
<b>Total</b>	<b>6.4 %</b>	<b>6.6 %</b>	<b>6.2 %</b>	<b>6.4 %</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**

Sectores	13 al 17 de febrero				20 al 24 de febrero				27 de feb. al 3 de marzo			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
<b>Sector Financiero**</b>	22	141	3793	3532	22	136	2751	2801	24	102	3681	2770
<b>Intragrupa y off-shore***</b>	0	0	1506	1402	0	0	1386	1115	0	0	1136	1477
<b>Otros</b>	141	22	886	1251	136	22	863	1079	102	24	850	1420
<b>Total</b>	<b>163</b>	<b>163</b>	<b>6186</b>	<b>6186</b>	<b>158</b>	<b>158</b>	<b>5000</b>	<b>4995</b>	<b>126</b>	<b>126</b>	<b>5667</b>	<b>5667</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.