

Fecha de Publicación: 22 de febrero de 2017

Fecha de Información: 20 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\$79.0 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 6.2%.<sup>2</sup>

**Cuadro No. 1**  
**Contratos Forwards Pactados**

Rango	Sector Financiero**		Intragrupa y Off-shore***		Otros Agentes		Interbancarios
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	24.9	1.9	0.9	4.9	1.0	20.0	0.0
15-35	7.7	8.9	2.0	4.9	6.9	2.8	0.0
36-60	2.9	1.7	0.0	0.0	1.7	2.9	0.0
61-90	5.9	1.1	0.0	0.0	1.1	5.9	0.0
91-180	0.0	16.7	0.0	0.0	16.7	0.0	0.0
>180	1.1	6.0	3.8	0.0	2.1	1.1	0.0
<b>Total</b>	<b>42.6</b>	<b>36.3</b>	<b>6.7</b>	<b>9.8</b>	<b>29.6</b>	<b>32.8</b>	<b>0.0</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	-	6.9 %	6.1 %	6.1 %
15-35	-	6.9 %	4.5 %	5.9 %
36-60	-	6.9 %	6.0 %	6.4 %
61-90	-	7.2 %	6.1 %	6.3 %
91-180	-	6.4 %	6.0 %	6.4 %
>180	-	6.2 %	5.9 %	6.1 %
<b>Total</b>	-	<b>6.6 %</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**

Sectores	20 al 24 de febrero				27 de feb. al 3 de marzo				6 al 10 de marzo			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	21	139	3359	3235	28	106	3919	3046	16	88	2989	2484
Intragrupa y off-shore***	0	0	1504	1374	0	0	1267	1548	0	0	910	1098
Otros	139	21	925	1174	106	28	886	1478	88	16	1024	1340
<b>Total</b>	<b>160</b>	<b>160</b>	<b>5787</b>	<b>5782</b>	<b>134</b>	<b>134</b>	<b>6072</b>	<b>6072</b>	<b>104</b>	<b>104</b>	<b>4923</b>	<b>4923</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.