

Fecha de Publicación: 23 de febrero de 2017

Fecha de Información: 21 de febrero 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\$1704.0 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	175.5	164.9	110.0	130.5	29.9	20.0	25.0
15-35	630.6	557.0	254.5	199.0	178.0	307.1	124.5
36-60	58.4	57.4	0.2	0.0	37.2	38.4	20.0
61-90	8.9	35.5	20.0	0.0	10.5	3.9	5.0
91-180	51.7	43.0	0.0	30.0	23.0	1.7	20.0
>180	82.8	52.9	18.0	46.8	14.9	16.0	20.0
<b>Total</b>	<b>1008.0</b>	<b>910.6</b>	<b>402.7</b>	<b>406.3</b>	<b>293.4</b>	<b>387.2</b>	<b>214.5</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	6.5 %	6.1 %	5.8 %	6.0 %
15-35	6.5 %	6.8 %	6.5 %	6.6 %
36-60	6.2 %	6.4 %	6.2 %	6.3 %
61-90	6.3 %	6.4 %	6.2 %	6.4 %
91-180	6.1 %	6.6 %	6.1 %	6.3 %
>180	5.8 %	6.0 %	5.5 %	5.7 %
<b>Total</b>	<b>6.4 %</b>	<b>6.6 %</b>	<b>6.3 %</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**

Sector	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	142	3456	3312	28	104	3997	3103	16	89	3054	2521
Intragrupa y off-shore***	0	0	1555	1449	0	0	1301	1603	0	0	945	1122
Otros	142	21	938	1182	104	28	898	1490	89	16	1025	1381
<b>Total</b>	<b>163</b>	<b>163</b>	<b>5948</b>	<b>5943</b>	<b>132</b>	<b>132</b>	<b>6195</b>	<b>6195</b>	<b>105</b>	<b>105</b>	<b>5024</b>	<b>5024</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.