

**Fecha de Publicación: 24 de febrero de 2017**

**Fecha de Información: 22 de febrero de miércoles <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\$1863.0 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 6.0%.<sup>2</sup>

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

| Rango        | Sector Financiero** |              | Intragrupo y Off-shore*** |              | Otros Agentes |              | Interbancarios |
|--------------|---------------------|--------------|---------------------------|--------------|---------------|--------------|----------------|
|              | Compras             | Ventas       | Compras                   | Ventas       | Compras       | Ventas       |                |
| 3-14         | 272.1               | 234.5        | 192.3                     | 245.0        | 30.3          | 15.1         | 12.0           |
| 15-35        | 637.2               | 512.9        | 286.5                     | 283.0        | 154.4         | 282.2        | 72.0           |
| 36-60        | 18.3                | 54.5         | 40.0                      | 5.0          | 4.5           | 3.3          | 10.0           |
| 61-90        | 80.5                | 13.2         | 0.0                       | 80.0         | 13.2          | 0.5          | 0.0            |
| 91-180       | 19.3                | 41.2         | 0.0                       | 0.0          | 41.2          | 19.3         | 0.0            |
| >180         | 52.9                | 50.5         | 0.0                       | 10.0         | 20.5          | 12.9         | 30.0           |
| <b>Total</b> | <b>1080.3</b>       | <b>906.7</b> | <b>518.8</b>              | <b>623.0</b> | <b>264.0</b>  | <b>333.3</b> | <b>124.0</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         | 6.3 %              | 5.6 %                        | 3.9 %        | 5.1 %        |
| 15-35        | 6.4 %              | 6.4 %                        | 6.2 %        | 6.3 %        |
| 36-60        | 6.4 %              | 6.4 %                        | 6.2 %        | 6.4 %        |
| 61-90        | -                  | 6.6 %                        | 6.2 %        | 6.2 %        |
| 91-180       | -                  | 6.5 %                        | 6.2 %        | 6.4 %        |
| >180         | 5.8 %              | 5.8 %                        | 5.8 %        | 5.8 %        |
| <b>Total</b> | <b>6.2 %</b>       | <b>6.1 %</b>                 | <b>5.8 %</b> | <b>6.0 %</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           |
| <b>Sector Financiero**</b>       | 21                  | 136        | 3618        | 3396        | 27                       | 104        | 4088        | 3252        | 16               | 92         | 3074        | 2524        |
| <b>Intragrupo y off-shore***</b> | 0                   | 0          | 1639        | 1610        | 0                        | 0          | 1409        | 1674        | 0                | 0          | 945         | 1135        |
| <b>Otros</b>                     | 136                 | 21         | 938         | 1183        | 104                      | 27         | 927         | 1498        | 92               | 16         | 1029        | 1388        |
| <b>Total</b>                     | <b>157</b>          | <b>157</b> | <b>6194</b> | <b>6189</b> | <b>131</b>               | <b>131</b> | <b>6424</b> | <b>6424</b> | <b>108</b>       | <b>108</b> | <b>5048</b> | <b>5048</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.