

Fecha de Publicación: 27 de febrero de 2017

Fecha de Información: 23 de febrero de jueves <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\$1964.1 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 6.0%.<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	318.0	260.4	99.3	158.5	20.1	18.5	141.0
15-35	823.4	478.2	224.2	388.9	116.0	296.6	138.0
36-60	0.0	9.5	0.0	0.0	9.5	0.0	0.0
61-90	1.8	16.1	0.0	0.0	15.1	0.8	1.0
91-180	96.4	149.8	10.0	10.0	138.8	85.4	1.0
>180	51.8	89.7	20.0	0.0	19.7	1.8	50.0
<b>Total</b>	<b>1291.5</b>	<b>1003.7</b>	<b>353.5</b>	<b>557.4</b>	<b>319.2</b>	<b>403.1</b>	<b>331.0</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	5.4 %	7.7 %	5.5 %	6.0 %
15-35	6.2 %	5.6 %	6.2 %	6.0 %
36-60	-	6.4 %	4.5 %	6.4 %
61-90	6.2 %	6.7 %	5.9 %	6.7 %
91-180	6.1 %	6.2 %	6.0 %	6.1 %
>180	5.4 %	6.0 %	5.4 %	5.7 %
<b>Total</b>	<b>5.8 %</b>	<b>6.1 %</b>	<b>6.0 %</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
Sector Financiero**	22	128	3716	3429	27	100	4263	3424	17	92	3132	2578
Intragrupa y off-shore***	0	0	1653	1691	0	0	1481	1747	0	0	959	1152
Otros	128	22	936	1181	100	27	937	1510	92	17	1038	1400
<b>Total</b>	<b>150</b>	<b>150</b>	<b>6306</b>	<b>6301</b>	<b>127</b>	<b>127</b>	<b>6681</b>	<b>6681</b>	<b>109</b>	<b>109</b>	<b>5129</b>	<b>5129</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.