

Fecha de Publicación: 11 de enero de 2017

Fecha de Información: 06 de enero de viernes <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\$1071.2 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	144.6	189.5	105.0	64.3	11.5	7.3	73.0
15-35	369.9	360.2	161.1	135.3	69.1	104.6	130.0
36-60	0.9	26.3	0.0	0.0	26.3	0.9	0.0
61-90	32.8	29.5	0.0	30.0	29.5	2.8	0.0
91-180	5.8	28.1	0.0	0.0	23.1	0.8	5.0
>180	66.5	45.0	5.0	40.0	20.0	6.5	20.0
<b>Total</b>	<b>620.6</b>	<b>678.6</b>	<b>271.1</b>	<b>269.6</b>	<b>179.5</b>	<b>122.9</b>	<b>228.0</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	6.8 %	6.6 %	1.7 %	6.2 %
15-35	7.1 %	5.9 %	6.5 %	6.5 %
36-60	-	7.2 %	6.2 %	7.1 %
61-90	-	6.8 %	6.5 %	6.7 %
91-180	6.4 %	6.3 %	5.5 %	6.3 %
>180	5.5 %	5.8 %	5.5 %	5.6 %
<b>Total</b>	<b>6.8 %</b>	<b>6.3 %</b>	<b>6.1 %</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	2 al 6 de enero						9 al 13 de enero				16 al 20 de enero			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF			
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V		
Sector Financiero**	28	63	2701	2814	11	113	3174	2940	13	117	2256	2069		
Intragrupa y off-shore***	0	0	1260	1104	0	0	1268	1255	0	0	911	804		
Otros	63	28	551	558	113	11	745	992	117	13	608	901		
<b>Total</b>	<b>91</b>	<b>91</b>	<b>4512</b>	<b>4476</b>	<b>125</b>	<b>125</b>	<b>5187</b>	<b>5187</b>	<b>130</b>	<b>130</b>	<b>3774</b>	<b>3774</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.