

Fecha de Publicación: 16 de enero de 2017

Fecha de Información: 12 de enero 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\$1571.9 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 6.5%.<sup>2</sup>

**Cuadro No. 1**  
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero**		Intragruppo y Off-shore***		Otros Agentes		Interbancarios
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	168.4	179.1	112.4	96.0	7.7	13.4	59.0
15-35	721.0	432.8	147.1	293.5	124.8	266.5	161.0
36-60	30.3	43.6	0.0	0.0	43.6	30.3	0.0
61-90	41.6	95.2	63.0	10.0	12.2	11.6	20.0
91-180	0.3	31.8	0.0	0.0	31.8	0.3	0.0
>180	28.5	64.3	10.3	0.0	29.1	3.5	25.0
<b>Total</b>	<b>990.0</b>	<b>846.9</b>	<b>332.7</b>	<b>399.5</b>	<b>249.2</b>	<b>325.5</b>	<b>265.0</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 intragruppo		Total
	Compras/Ventas	Compras	Ventas	
3-14	6.3 %	5.7 %	4.5 %	5.5 %
15-35	6.7 %	6.9 %	6.7 %	6.7 %
36-60	-	7.0 %	6.7 %	6.9 %
61-90	6.6 %	6.6 %	6.6 %	6.6 %
91-180	-	6.6 %	6.1 %	6.6 %
>180	5.8 %	5.8 %	5.3 %	5.7 %
<b>Total</b>	<b>6.5 %</b>	<b>6.5 %</b>	<b>6.4 %</b>	<b>6.5 %</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	9 al 13 de enero				16 al 20 de enero				23 al 27 de enero			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	12	109	3486	3277	20	116	2427	2230	16	147	2168	2024
Intragruppo y off-shore***	0	0	1558	1408	0	0	998	886	0	0	948	695
Otros	109	12	718	1076	116	20	622	931	147	16	706	1102
<b>Total</b>	<b>121</b>	<b>121</b>	<b>5762</b>	<b>5762</b>	<b>136</b>	<b>136</b>	<b>4047</b>	<b>4047</b>	<b>163</b>	<b>163</b>	<b>3821</b>	<b>3821</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: ((Tasa Pactada/Tasa de Contado) ^ (360/Plazo)) - 1. Para el cálculo de la devaluación implícita se excluyen las operaciones intragruppo.