

Fecha de Publicación: 18 de enero de 2017

Fecha de Información: 16 de enero de lunes <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\$233.7 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 6.3%.<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	55.6	62.6	29.5	18.0	8.1	12.6	25.0
15-35	61.1	47.9	40.5	52.4	2.4	3.7	5.0
36-60	3.2	3.5	0.0	0.0	3.5	3.2	0.0
61-90	0.1	14.3	0.0	0.0	14.3	0.1	0.0
91-180	2.1	5.1	0.0	0.0	5.1	2.1	0.0
>180	0.0	8.3	0.0	0.0	8.3	0.0	0.0
<b>Total</b>	<b>122.1</b>	<b>141.6</b>	<b>70.0</b>	<b>70.4</b>	<b>41.6</b>	<b>21.7</b>	<b>30.0</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	6.7 %	6.4 %	5.4 %	6.1 %
15-35	6.8 %	6.6 %	6.2 %	6.4 %
36-60	-	7.0 %	6.2 %	6.6 %
61-90	-	6.8 %	6.5 %	6.8 %
91-180	-	7.1 %	6.2 %	6.9 %
>180	-	6.2 %	-	6.2 %
<b>Total</b>	<b>6.7 %</b>	<b>6.6 %</b>	<b>5.9 %</b>	<b>6.3 %</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	16 al 20 de enero				23 al 27 de enero				30 de ene. al 3 de febrero			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
<b>Sector Financiero**</b>	23	117	2655	2393	16	155	2216	2159	8	88	2483	2279
<b>Intragrupa y off-shore***</b>	0	0	1087	1012	0	0	1011	696	0	0	784	786
<b>Otros</b>	117	23	612	949	155	16	745	1118	88	8	698	899
<b>Total</b>	<b>140</b>	<b>140</b>	<b>4354</b>	<b>4354</b>	<b>171</b>	<b>171</b>	<b>3972</b>	<b>3972</b>	<b>96</b>	<b>96</b>	<b>3964</b>	<b>3964</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.