

Fecha de Publicación: 24 de enero de 2017

Fecha de Información: 20 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\$1015.2 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 6.4%.<sup>2</sup>

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

Rango	Sector Financiero**		Intragruppo y Off-shore***		Otros Agentes		Interbancarios
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	66.8	220.9	139.5	18.5	50.4	17.3	31.0
15-35	458.3	173.2	103.0	273.5	24.2	138.8	46.0
36-60	8.0	12.6	0.0	0.0	12.6	8.0	0.0
61-90	23.1	43.7	10.0	1.2	13.7	1.9	20.0
91-180	37.4	67.5	10.0	15.0	37.5	2.4	20.0
>180	8.2	15.6	0.0	5.0	12.6	0.2	3.0
<b>Total</b>	<b>601.7</b>	<b>533.5</b>	<b>262.5</b>	<b>313.2</b>	<b>151.0</b>	<b>168.5</b>	<b>120.0</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	6.4 %	6.5 %	5.9 %	6.4 %
15-35	6.4 %	6.6 %	6.4 %	6.4 %
36-60	-	7.0 %	5.6 %	6.5 %
61-90	6.3 %	6.5 %	6.2 %	6.4 %
91-180	5.9 %	6.3 %	5.8 %	6.1 %
>180	5.0 %	6.1 %	5.3 %	5.7 %
<b>Total</b>	<b>6.3 %</b>	<b>6.5 %</b>	<b>6.3 %</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.

<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:  $((Tasa\ Pactada/Tasa\ de\ Contado) \wedge (360/Plazo)) - 1$ . Para el cálculo de la devaluación implícita se excluyen las operaciones intragrupo.

**Cuadro No. 3**  
**Vencimientos de Forwards**

Sectores	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>	24	114	3165	2718	18	167	2533	2520	8	88	2607	2488
<b>Intragruppo y off-shore***</b>	0	0	1229	1337	0	0	1161	809	0	0	858	803
<b>Otros</b>	114	24	614	953	167	18	814	1180	88	8	763	937
<b>Total</b>	<b>137</b>	<b>137</b>	<b>5008</b>	<b>5008</b>	<b>185</b>	<b>185</b>	<b>4508</b>	<b>4508</b>	<b>96</b>	<b>96</b>	<b>4228</b>	<b>4228</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.