

Fecha de Publicación: 26 de enero de 2017

Fecha de Información: 24 de enero de martes <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\$1664.1 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	249.1	262.3	143.0	132.5	21.7	19.1	97.5
15-35	577.8	475.5	192.8	194.5	91.2	191.8	191.5
36-60	4.1	44.1	35.0	0.0	9.1	4.1	0.0
61-90	123.3	104.5	20.0	30.0	84.5	93.3	0.0
91-180	3.2	27.7	0.0	0.0	27.7	3.2	0.0
>180	40.2	51.1	30.0	30.0	11.1	0.2	10.0
<b>Total</b>	<b>997.9</b>	<b>965.2</b>	<b>420.8</b>	<b>387.0</b>	<b>245.4</b>	<b>311.9</b>	<b>299.0</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	6.2 %	7.0 %	6.3 %	6.5 %
15-35	6.6 %	6.6 %	6.5 %	6.5 %
36-60	-	6.7 %	6.3 %	6.6 %
61-90	-	6.2 %	6.1 %	6.2 %
91-180	-	6.2 %	5.8 %	6.2 %
>180	5.5 %	5.6 %	5.5 %	5.6 %
<b>Total</b>	-	6.5 %	6.3 %	6.4 %

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

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

Sectores	23 al 27 de enero				30 de ene. al 3 de febrero				6 al 10 de febrero			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
<b>Sector Financiero**</b>	19	169	2744	2708	9	90	2739	2628	6	78	2133	2089
<b>Intragruppo y off-shore***</b>	0	0	1286	954	0	0	932	865	0	0	826	738
<b>Otros</b>	169	19	820	1188	90	9	789	968	78	6	767	875
<b>Total</b>	<b>187</b>	<b>187</b>	<b>4851</b>	<b>4851</b>	<b>99</b>	<b>99</b>	<b>4460</b>	<b>4460</b>	<b>84</b>	<b>84</b>	<b>3726</b>	<b>3701</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.