

**Fecha de Publicación: 6 de enero de 2017**

**Fecha de Información: 04 de enero de miércoles<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\$1469.6 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 6.2%.<sup>2</sup>

**Cuadro No. 1  
Contratos Forwards Pactados**

Rango	Sector Financiero**		Intragruop y Off-shore***		Otros Agentes		Interbancarios
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	256.4	200.0	106.0	195.0	34.0	1.4	60.0
15-35	440.4	443.7	269.3	278.3	82.2	69.9	92.3
36-60	48.5	29.6	15.0	43.0	14.6	5.5	0.0
61-90	46.6	68.5	10.0	10.0	58.5	36.6	0.0
91-180	0.1	35.1	5.0	0.0	30.1	0.1	0.0
>180	45.0	13.0	5.0	40.0	3.0	0.0	5.0
<b>Total</b>	<b>837.0</b>	<b>789.8</b>	<b>410.3</b>	<b>566.3</b>	<b>222.3</b>	<b>113.5</b>	<b>157.3</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 intragruop		Total
		Compras	Ventas	
3-14	6.8 %	6.5 %	3.6 %	5.2 %
15-35	6.9 %	6.8 %	6.4 %	6.6 %
36-60	-	6.6 %	6.6 %	6.6 %
61-90	-	6.5 %	6.3 %	6.5 %
91-180	-	6.0 %	6.1 %	6.0 %
>180	5.6 %	5.7 %	5.6 %	5.6 %
<b>Total</b>	<b>6.8 %</b>	<b>6.6 %</b>	<b>5.5 %</b>	<b>6.2 %</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	64	2656	2795	10	110	2905	2628	13	113	2127	1888
Intragruop y off-shore***	0	0	1260	1059	0	0	1159	1177	0	0	836	778
Otros	64	28	532	558	110	10	717	977	113	13	585	881
<b>Total</b>	<b>92</b>	<b>92</b>	<b>4448</b>	<b>4412</b>	<b>120</b>	<b>120</b>	<b>4782</b>	<b>4782</b>	<b>126</b>	<b>126</b>	<b>3547</b>	<b>3547</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 intragruop.