

**Fecha de Publicación: 27 de enero de 2017**

**Fecha de Información: 25 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\$978.5 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 6.5%.<sup>2</sup>

**Cuadro No. 1  
Contratos Forwards Pactados**

Rango	Sector Financiero**		Intragrupo y Off-shore***		Otros Agentes		Interbancarios
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	171.8	161.8	88.0	101.0	25.8	22.8	48.0
15-35	303.2	314.6	165.0	80.0	63.6	137.2	86.0
36-60	2.1	3.9	0.0	0.0	3.9	2.1	0.0
61-90	53.0	27.6	0.0	0.0	27.6	53.0	0.0
91-180	3.7	17.7	0.0	0.0	17.7	3.7	0.0
>180	36.6	36.4	0.0	10.0	16.4	6.6	20.0
<b>Total</b>	<b>570.5</b>	<b>562.0</b>	<b>253.0</b>	<b>191.0</b>	<b>155.0</b>	<b>225.5</b>	<b>154.0</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	
3-14	6.6 %	6.7 %	6.4 %	6.5 %
15-35	6.6 %	6.7 %	6.3 %	6.6 %
36-60	-	7.0 %	6.1 %	6.7 %
61-90	-	6.5 %	6.2 %	6.3 %
91-180	-	6.1 %	5.9 %	6.1 %
>180	5.7 %	5.8 %	5.3 %	5.6 %
<b>Total</b>	<b>6.5 %</b>	<b>6.6 %</b>	<b>6.2 %</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.

<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 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	168	2850	2792	9	93	2793	2689	6	79	2146	2110
<b>Intragrupo y off-shore***</b>	0	0	1336	1013	0	0	970	905	0	0	831	740
Otros	168	19	816	1197	93	9	812	981	79	6	773	876
Total	<b>186</b>	<b>186</b>	<b>5002</b>	<b>5002</b>	<b>102</b>	<b>102</b>	<b>4575</b>	<b>4575</b>	<b>85</b>	<b>85</b>	<b>3750</b>	<b>3725</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.