

Fecha de Publicación: 3 de enero de 2017

Fecha de Información: 29 de diciembre de jueves <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\$935.1 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 6.2%.<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	94.2	118.9	53.0	62.0	35.9	2.2	30.0
15-35	301.8	291.0	108.0	157.3	55.3	16.8	127.7
36-60	5.3	12.0	0.0	0.0	12.0	5.3	0.0
61-90	57.8	32.4	1.3	0.0	11.1	37.8	20.0
91-180	65.6	49.9	0.0	35.0	19.9	0.6	30.0
>180	89.4	100.5	10.0	10.0	14.5	3.4	76.0
<b>Total</b>	<b>614.0</b>	<b>604.7</b>	<b>172.3</b>	<b>264.3</b>	<b>148.8</b>	<b>66.1</b>	<b>283.7</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	7.1 %	7.2 %	6.3 %	6.8 %
15-35	6.3 %	6.8 %	5.6 %	6.2 %
36-60	-	7.2 %	5.5 %	6.7 %
61-90	6.7 %	6.7 %	6.1 %	6.4 %
91-180	6.2 %	6.4 %	6.1 %	6.2 %
>180	5.3 %	5.5 %	5.4 %	5.4 %
<b>Total</b>	<b>6.2 %</b>	<b>6.7 %</b>	<b>5.9 %</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.

<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	26 al 30 de diciembre				2 al 6 de enero				9 al 13 de enero			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
<b>Sector Financiero**</b>	25	156	1478	1660	27	60	2275	2599	10	108	2719	2515
<b>Intragruppo y off-shore***</b>	0	0	777	788	0	0	1173	789	0	0	1154	1090
<b>Otros</b>	156	25	466	274	60	27	518	542	108	10	667	935
<b>Total</b>	<b>181</b>	<b>181</b>	<b>2721</b>	<b>2721</b>	<b>87</b>	<b>87</b>	<b>3966</b>	<b>3930</b>	<b>118</b>	<b>118</b>	<b>4541</b>	<b>4541</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.