

Fecha de Publicación: 7 de diciembre de 2016

Fecha de Información: 05 de diciembre de lunes <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\$1764.9 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 8.0%.<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	320.4	330.0	137.0	134.0	106.0	99.4	87.0
15-35	271.0	361.0	204.5	126.5	48.5	36.5	108.0
36-60	200.1	164.0	29.5	55.0	68.5	79.1	66.0
61-90	83.6	101.9	19.2	0.0	82.7	83.6	0.0
91-180	28.9	16.0	0.0	0.0	16.0	28.9	0.0
>180	72.2	76.9	5.0	0.0	71.9	72.2	0.0
<b>Total</b>	<b>976.1</b>	<b>1049.8</b>	<b>395.2</b>	<b>315.5</b>	<b>393.6</b>	<b>399.6</b>	<b>261.0</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	10.2 %	8.6 %	8.6 %	8.9 %
15-35	8.7 %	8.7 %	7.0 %	8.3 %
36-60	7.6 %	8.0 %	8.2 %	8.0 %
61-90	-	6.7 %	7.0 %	6.8 %
91-180	-	7.4 %	6.9 %	7.0 %
>180	-	6.0 %	5.9 %	5.9 %
<b>Total</b>	<b>8.9 %</b>	<b>8.0 %</b>	<b>7.6 %</b>	<b>8.0 %</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	5 al 9 de diciembre				12 al 16 de diciembre				19 al 23 de diciembre			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	27	96	2746	3127	50	132	3012	3753	19	158	2160	2916
Intragrupa y off-shore***	0	0	1581	1188	0	0	1792	1233	0	0	1546	1012
Otros	96	27	872	884	132	50	1278	1086	158	19	666	444
<b>Total</b>	<b>123</b>	<b>123</b>	<b>5198</b>	<b>5198</b>	<b>182</b>	<b>182</b>	<b>6082</b>	<b>6072</b>	<b>177</b>	<b>177</b>	<b>4372</b>	<b>4372</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:  $((\text{Tasa Pactada}/\text{Tasa de Contado}) \wedge (360/\text{Plazo}) - 1)$ . Para el cálculo de la devaluación implícita se excluyen las operaciones intragrupo.