

**Fecha de Publicación: 12 de diciembre de 2016**

**Fecha de Información: 07 de diciembre 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\$1525.2 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 7.9%.<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	257.9	207.0	106.7	99.8	59.3	117.1	41.0
15-35	373.9	331.5	121.8	168.8	60.7	56.1	149.0
36-60	78.8	59.5	15.0	30.0	44.5	48.8	0.0
61-90	59.2	70.5	3.0	20.0	52.5	24.2	15.0
91-180	16.4	56.0	0.0	10.0	56.0	6.4	0.0
>180	67.2	181.5	40.0	0.0	112.4	38.1	29.1
<b>Total</b>	<b>853.4</b>	<b>905.9</b>	<b>286.5</b>	<b>328.6</b>	<b>385.3</b>	<b>290.8</b>	<b>234.1</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	8.8 %	8.4 %	8.0 %	8.2 %
15-35	8.5 %	9.5 %	8.4 %	8.8 %
36-60	-	8.3 %	7.8 %	8.0 %
61-90	7.5 %	7.6 %	7.0 %	7.4 %
91-180	-	7.1 %	6.8 %	7.1 %
>180	5.7 %	6.1 %	6.2 %	6.0 %
<b>Total</b>	<b>8.1 %</b>	<b>7.9 %</b>	<b>7.9 %</b>	<b>7.9 %</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:  $((Tasa\ Pactada/Tasa\ de\ Contado) \wedge (360/Plazo)) - 1$ . Para el cálculo de la devaluación implícita se excluyen las operaciones intragrupo.

**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
<b>Sector Financiero**</b>	26	106	2929	3165	50	132	3260	3975	20	165	2407	3211
<b>Intragrupa y off-shore***</b>	0	0	1611	1349	0	0	1880	1285	0	0	1690	1085
<b>Otros</b>	106	26	872	889	132	50	1335	1207	165	20	727	518
<b>Total</b>	<b>132</b>	<b>132</b>	<b>5412</b>	<b>5404</b>	<b>182</b>	<b>182</b>	<b>6476</b>	<b>6466</b>	<b>184</b>	<b>184</b>	<b>4824</b>	<b>4814</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.