

Fecha de Publicación: 13 de diciembre de 2016

Fecha de Información: 09 de diciembre de viernes ¹

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Según el reporte de los Intermediarios del Mercado Cambiario durante el día se pactó un total de US\$1143.8 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 8.2%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero**		Intragruppo y Off-shore***		Otros Agentes		Interbancarios
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	262.9	252.6	186.0	200.2	28.6	24.7	38.0
15-35	182.5	248.5	175.1	122.5	28.4	15.0	45.0
36-60	12.0	51.7	46.6	0.0	5.1	12.0	0.0
61-90	21.0	6.8	0.0	10.0	6.8	11.0	0.0
91-180	2.1	51.9	15.0	0.0	36.9	2.1	0.0
>180	52.1	82.8	0.0	0.7	82.8	51.4	0.0
Total	532.6	694.3	422.7	333.4	188.6	116.2	83.0

* 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	9.3 %	8.4 %	8.2 %	8.4 %
15-35	8.5 %	9.5 %	8.3 %	9.0 %
36-60	-	8.3 %	7.8 %	8.1 %
61-90	-	7.7 %	7.6 %	7.6 %
91-180	-	6.9 %	6.6 %	6.9 %
>180	-	5.9 %	6.2 %	6.0 %
Total	8.9 %	8.2 %	7.9 %	8.2 %

*Incluye solo operaciones interbancarias

En el cuadro No. 3 se presentan los vencimientos de forwards para ésta y las próximas dos semanas.

¹ Datos provisionales.

² 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
Sector Financiero**	26	105	2939	3165	50	134	3422	4133	20	166	2512	3317
Intragruppo y off-shore***	0	0	1611	1359	0	0	1986	1389	0	0	1780	1181
Otros	105	26	872	889	134	50	1356	1232	166	20	737	521
Total	131	131	5422	5414	183	184	6764	6754	185	185	5028	5018

* 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.