

Fecha de Publicación: 14 de diciembre de 2016

Fecha de Información: 12 de diciembre de lunes 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\$1208.0 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 7.9%.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	192.3	92.5	52.7	163.3	29.8	19.0	10.0
15-35	229.9	345.4	228.8	124.7	76.6	65.3	40.0
36-60	24.9	24.8	8.5	23.0	16.3	1.9	0.0
61-90	133.7	137.6	1.9	10.0	135.7	123.7	0.0
91-180	5.8	44.9	0.0	0.0	44.9	5.8	0.0
>180	0.0	26.2	0.3	0.0	25.9	0.0	0.0
Total	586.6	671.3	292.1	320.9	329.2	215.7	50.0

* 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	11.1 %	9.5 %	6.5 %	7.5 %
15-35	8.5 %	8.6 %	8.7 %	8.6 %
36-60	-	8.4 %	8.0 %	8.2 %
61-90	-	7.2 %	7.1 %	7.1 %
91-180	-	7.3 %	7.0 %	7.3 %
>180	-	6.2 %	-	6.2 %
Total	9.0 %	8.2 %	7.4 %	7.9 %

*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: $((\text{Tasa Pactada}/\text{Tasa de Contado}) \wedge (360/\text{Plazo})) - 1$. Para el cálculo de la devaluación implícita se excluyen las operaciones intragrupo.

Cuadro No. 3
Vencimientos de Forwards

Sectores	12 al 16 de diciembre				19 al 23 de diciembre				26 al 30 de diciembre			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	48	136	3593	4194	20	168	2533	3344	19	133	1167	1440
Intragruppo y off-shore***	0	0	2037	1552	0	0	1782	1181	0	0	703	592
Otros	136	48	1361	1235	168	20	757	537	133	19	366	204
Total	184	184	6992	6982	188	188	5071	5061	153	153	2236	2236

* 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.