

Fecha de Publicación: 15 de diciembre de 2016

Fecha de Información: 13 de diciembre de martes 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\$1660.1 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	290.3	137.9	37.5	213.9	36.6	12.6	63.8
15-35	503.7	549.6	270.4	203.4	122.2	143.3	157.0
36-60	24.9	31.0	3.5	0.0	12.5	9.9	15.0
61-90	73.1	29.7	0.0	53.0	19.7	10.1	10.0
91-180	2.9	54.6	0.0	0.0	54.6	2.9	0.0
>180	77.4	130.8	60.0	10.0	70.8	67.4	0.0
Total	972.2	933.6	371.4	480.3	316.4	246.1	245.8

* 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	9.2 %	9.2 %	7.2 %	8.1 %
15-35	8.3 %	8.3 %	8.2 %	8.3 %
36-60	7.6 %	8.7 %	8.0 %	8.1 %
61-90	7.2 %	7.7 %	6.6 %	6.9 %
91-180	-	7.1 %	6.8 %	7.1 %
>180	-	6.3 %	6.1 %	6.2 %
Total	8.4 %	8.0 %	7.5 %	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**	46	138	3762	4273	21	171	2622	3382	20	134	1213	1466
Intragruppo y off-shore***	0	0	2062	1669	0	0	1795	1258	0	0	703	613
Otros	137	46	1365	1236	171	21	779	546	134	20	382	219
Total	183	184	7189	7179	191	191	5196	5186	154	154	2298	2298

* 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.