

Fecha de Publicación: 15 de diciembre de 2016

Fecha de Información: 13 de diciembre de martes <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\$1660.1 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	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
<b>Total</b>	<b>972.2</b>	<b>933.6</b>	<b>371.4</b>	<b>480.3</b>	<b>316.4</b>	<b>246.1</b>	<b>245.8</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	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 %
<b>Total</b>	<b>8.4 %</b>	<b>8.0 %</b>	<b>7.5 %</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) ^ (360/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
<b>Sector Financiero**</b>	46	138	3762	4273	21	171	2622	3382	20	134	1213	1466
<b>Intragruppo y off-shore***</b>	0	0	2062	1669	0	0	1795	1258	0	0	703	613
<b>Otros</b>	137	46	1365	1236	171	21	779	546	134	20	382	219
<b>Total</b>	<b>183</b>	<b>184</b>	<b>7189</b>	<b>7179</b>	<b>191</b>	<b>191</b>	<b>5196</b>	<b>5186</b>	<b>154</b>	<b>154</b>	<b>2298</b>	<b>2298</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.