

Fecha de Publicación: 16 de diciembre de 2016

Fecha de Información: 14 de diciembre de miércoles 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\$1141.5 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	113.9	71.9	20.0	77.5	34.9	19.4	17.0
15-35	411.5	365.8	101.0	154.0	78.3	71.0	186.5
36-60	38.7	73.4	0.0	0.0	73.4	38.7	0.0
61-90	19.0	46.9	0.0	11.0	46.9	8.0	0.0
91-180	0.7	46.7	0.0	0.0	46.7	0.7	0.0
>180	46.5	117.0	40.0	0.0	70.0	39.5	7.0
Total	630.2	721.7	161.0	242.5	350.2	177.2	210.5

* 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 intragruppo		Total
	Compras/Ventas	Compras	Ventas	
3-14	7.9 %	9.3 %	8.1 %	8.5 %
15-35	8.0 %	8.1 %	7.9 %	8.0 %
36-60	-	8.4 %	8.7 %	8.5 %
61-90	-	7.3 %	6.7 %	7.1 %
91-180	-	7.0 %	5.9 %	6.9 %
>180	5.6 %	6.8 %	7.9 %	7.0 %
Total	7.9 %	7.8 %	8.0 %	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 intragruppo.

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**	26	136	3851	4314	41	178	2646	3405	20	136	1215	1474
Intragruppo y off-shore***	0	0	2081	1744	0	0	1796	1258	0	0	703	616
Otros	136	26	1375	1239	178	41	795	564	136	20	390	219
Total	162	162	7307	7297	219	219	5237	5227	157	157	2308	2308

* 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.