

**Fecha de Publicación: 16 de diciembre de 2016**

**Fecha de Información: 14 de diciembre de miércoles <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\$1141.5 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	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
<b>Total</b>	<b>630.2</b>	<b>721.7</b>	<b>161.0</b>	<b>242.5</b>	<b>350.2</b>	<b>177.2</b>	<b>210.5</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	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 %
<b>Total</b>	<b>7.9 %</b>	<b>7.8 %</b>	<b>8.0 %</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:  $((\text{Tasa Pactada}/\text{Tasa de Contado}) \wedge (360/\text{Plazo})) - 1$ . 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
<b>Sector Financiero**</b>	26	136	3851	4314	41	178	2646	3405	20	136	1215	1474
<b>Intragruppo y off-shore***</b>	0	0	2081	1744	0	0	1796	1258	0	0	703	616
<b>Otros</b>	136	26	1375	1239	178	41	795	564	136	20	390	219
<b>Total</b>	<b>162</b>	<b>162</b>	<b>7307</b>	<b>7297</b>	<b>219</b>	<b>219</b>	<b>5237</b>	<b>5227</b>	<b>157</b>	<b>157</b>	<b>2308</b>	<b>2308</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.