

Fecha de Publicación: 20 de diciembre de 2016

Fecha de Información: 16 de diciembre de viernes 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\$1584.3 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 7.1%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero**		Intragrupa y Off-shore***		Otros Agentes		Interbancarios
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	206.8	122.6	42.0	70.0	12.6	68.8	68.0
15-35	483.6	448.5	205.0	174.0	61.1	127.2	182.4
36-60	150.5	153.2	0.0	0.0	153.2	150.5	0.0
61-90	72.7	63.6	0.0	20.0	23.6	12.7	40.0
91-180	1.3	62.9	0.0	0.0	62.9	1.3	0.0
>180	0.0	109.1	100.0	0.0	9.1	0.0	0.0
Total	914.8	959.9	347.0	264.0	322.5	360.4	290.4

* 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	8.1 %	7.9 %	6.9 %	7.4 %
15-35	7.5 %	7.4 %	7.7 %	7.5 %
36-60	-	6.8 %	6.4 %	6.6 %
61-90	6.6 %	6.6 %	6.3 %	6.5 %
91-180	-	6.8 %	5.9 %	6.8 %
>180	-	5.9 %	-	5.9 %
Total	7.5 %	7.0 %	7.1 %	7.1 %

*Incluye solo operaciones interbancarias

En el cuadro No. 3 se presentan los vencimientos de forwards para ésta y las próximas dos semanas.

Cuadro No. 3
Vencimientos de Forwards

Sector	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**	27	135	3909	4306	40	171	2712	3494	20	135	1235	1497
Intragrupa y off-shore***	0	0	2081	1802	0	0	1854	1290	0	0	728	638
Otros	135	27	1367	1239	171	40	816	587	135	20	388	217
Total	162	162	7357	7347	211	211	5381	5371	155	155	2352	2352

* 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.

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: ((Tasa Pactada/Tasa de Contado) ^ (360/Plazo)) - 1. Para el cálculo de la devaluación implícita se excluyen las operaciones intragrupo.