

Fecha de Publicación: 21 de diciembre de 2016

Fecha de Información: 19 de diciembre de lunes <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\$990.4 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 7.4%.<sup>2</sup>

**Cuadro No. 1**  
**Contratos Forwards Pactados**

Rango	Sector Financiero**		Intragrupo y Off-shore***		Otros Agentes		Interbancarios
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	205.7	72.8	47.0	157.2	10.8	33.5	15.0
15-35	168.6	311.2	151.4	37.0	57.8	29.6	102.0
36-60	93.5	90.6	2.0	0.0	88.6	93.5	0.0
61-90	8.6	108.1	105.2	0.0	2.9	8.6	0.0
91-180	5.2	10.9	0.0	0.0	10.9	5.2	0.0
>180	31.9	5.3	0.0	25.0	0.3	1.9	5.0
<b>Total</b>	<b>513.4</b>	<b>599.0</b>	<b>305.6</b>	<b>219.2</b>	<b>171.4</b>	<b>172.2</b>	<b>122.0</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	8.0 %	7.7 %	8.7 %	8.3 %
15-35	7.5 %	7.4 %	7.4 %	7.4 %
36-60	-	6.9 %	6.7 %	6.8 %
61-90	-	6.9 %	6.2 %	6.7 %
91-180	-	6.8 %	5.7 %	6.5 %
>180	5.2 %	6.0 %	5.1 %	5.1 %
<b>Total</b>	<b>7.5 %</b>	<b>7.3 %</b>	<b>7.6 %</b>	<b>7.4 %</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	19 al 23 de diciembre				26 al 30 de diciembre				2 al 6 de enero			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
<b>Sector Financiero**</b>	40	172	2897	3551	23	138	1249	1506	14	59	1920	2189
<b>Intragruppo y off-shore***</b>	0	0	1894	1447	0	0	735	638	0	0	957	724
<b>Otros</b>	172	40	818	600	138	23	390	230	59	14	465	394
<b>Total</b>	<b>212</b>	<b>212</b>	<b>5608</b>	<b>5598</b>	<b>161</b>	<b>161</b>	<b>2374</b>	<b>2374</b>	<b>72</b>	<b>72</b>	<b>3342</b>	<b>3306</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.