

Fecha de Publicación: 21 de diciembre de 2016

Fecha de Información: 19 de diciembre de lunes 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\$990.4 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 7.4%.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	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
Total	513.4	599.0	305.6	219.2	171.4	172.2	122.0

* 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 %
Total	7.5 %	7.3 %	7.6 %	7.4 %

*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 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
Sector Financiero**	40	172	2897	3551	23	138	1249	1506	14	59	1920	2189
Intragruppo y off-shore***	0	0	1894	1447	0	0	735	638	0	0	957	724
Otros	172	40	818	600	138	23	390	230	59	14	465	394
Total	212	212	5608	5598	161	161	2374	2374	72	72	3342	3306

* 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.