

**Fecha de Publicación: 22 de diciembre de 2016**

**Fecha de Información: 20 de diciembre de martes <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\$1172.8 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 7.1%.<sup>2</sup>

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

Rango	Sector Financiero**		Intragruppo y Off-shore***		Otros Agentes		Interbancarios
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	199.0	81.3	9.5	130.3	23.8	20.7	48.0
15-35	298.6	299.3	143.5	119.0	44.8	68.6	111.0
36-60	97.7	94.2	10.0	21.4	84.2	76.3	0.0
61-90	44.4	125.4	69.3	2.5	56.1	41.9	0.0
91-180	3.7	23.3	2.0	3.3	21.3	0.4	0.0
>180	41.9	55.8	18.9	8.0	4.0	0.9	33.0
<b>Total</b>	<b>685.5</b>	<b>679.3</b>	<b>253.2</b>	<b>284.5</b>	<b>234.1</b>	<b>209.0</b>	<b>192.0</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 intragruppo		Total
	Compras/Ventas	Compras	Ventas	
3-14	8.2 %	8.8 %	7.6 %	8.0 %
15-35	7.3 %	7.2 %	7.3 %	7.2 %
36-60	-	6.6 %	6.6 %	6.6 %
61-90	-	7.0 %	7.0 %	7.0 %
91-180	-	6.5 %	4.3 %	6.5 %
>180	5.4 %	5.6 %	5.5 %	5.5 %
<b>Total</b>	<b>7.2 %</b>	<b>7.0 %</b>	<b>7.1 %</b>	<b>7.1 %</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 intragruppo.

**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	174	3078	3597	24	141	1265	1540	14	59	1957	2249
<b>Intragruppo y off-shore***</b>	0	0	1895	1587	0	0	743	638	0	0	1003	714
<b>Otros</b>	174	40	821	600	141	24	409	240	59	14	458	419
<b>Total</b>	<b>214</b>	<b>214</b>	<b>5794</b>	<b>5784</b>	<b>165</b>	<b>165</b>	<b>2418</b>	<b>2418</b>	<b>72</b>	<b>72</b>	<b>3418</b>	<b>3382</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.