

Fecha de Publicación: 22 de diciembre de 2016

Fecha de Información: 20 de diciembre de martes 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\$1172.8 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 7.1%.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	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
Total	685.5	679.3	253.2	284.5	234.1	209.0	192.0

* 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 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 %
Total	7.2 %	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.

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

* 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.