

Fecha de Publicación: 23 de diciembre de 2016

Fecha de Información: 21 de diciembre de miércoles 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\$1293.6 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	184.2	124.5	49.8	119.3	48.7	38.9	26.0
15-35	334.6	546.0	313.6	122.0	51.8	32.0	180.6
36-60	48.3	68.6	0.0	0.0	68.6	48.3	0.0
61-90	22.1	40.9	1.0	0.0	24.9	7.1	15.0
91-180	0.8	12.5	0.0	0.0	12.5	0.8	0.0
>180	127.9	79.7	0.0	40.0	4.7	12.9	75.0
Total	718.0	872.2	364.4	281.3	211.3	140.1	296.6

* 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	7.9 %	9.4 %	7.1 %	8.2 %
15-35	7.1 %	7.4 %	6.9 %	7.2 %
36-60	-	6.9 %	6.8 %	6.9 %
61-90	6.2 %	6.4 %	6.1 %	6.3 %
91-180	-	6.3 %	5.5 %	6.3 %
>180	5.5 %	6.0 %	5.0 %	5.3 %
Total	6.7 %	7.6 %	6.7 %	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: $((\text{Tasa Pactada}/\text{Tasa de Contado}) \wedge (360/\text{Plazo})) - 1$. 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	185	3177	3650	29	145	1318	1603	14	57	2008	2302
Intragruppo y off-shore***	0	0	1937	1673	0	0	750	671	0	0	1027	714
Otros	185	40	822	603	145	29	450	244	57	14	468	453
Total	225	225	5935	5925	174	174	2518	2518	71	71	3504	3468

* 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.