

Fecha de Publicación: 26 de diciembre de 2016

Fecha de Información: 22 de diciembre de jueves <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\$772.7 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 7.2%.<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	113.8	68.3	38.5	98.0	29.8	15.8	0.0
15-35	196.9	224.1	160.4	84.0	25.7	74.9	38.0
36-60	84.9	69.9	0.0	10.3	69.9	74.7	0.0
61-90	0.8	8.6	0.0	0.0	8.6	0.8	0.0
91-180	5.5	22.0	0.0	0.0	16.9	0.3	5.1
>180	5.4	15.9	0.0	0.0	15.6	5.1	0.3
<b>Total</b>	<b>407.4</b>	<b>408.8</b>	<b>198.9</b>	<b>192.3</b>	<b>166.5</b>	<b>171.6</b>	<b>43.5</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	-	7.2 %	10.8 %	8.9 %
15-35	7.2 %	7.1 %	6.5 %	6.8 %
36-60	-	6.9 %	6.7 %	6.8 %
61-90	6.8 %	7.4 %	6.1 %	7.3 %
91-180	6.2 %	6.5 %	4.9 %	6.4 %
>180	5.8 %	5.6 %	5.1 %	5.5 %
<b>Total</b>	<b>7.0 %</b>	<b>7.0 %</b>	<b>7.5 %</b>	<b>7.2 %</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	190	3254	3656	28	146	1348	1619	14	57	2025	2352
<b>Intragruppo y off-shore***</b>	0	0	1942	1752	0	0	756	690	0	0	1054	714
<b>Otros</b>	190	40	822	601	146	28	460	255	57	14	482	459
<b>Total</b>	<b>230</b>	<b>230</b>	<b>6018</b>	<b>6008</b>	<b>174</b>	<b>174</b>	<b>2564</b>	<b>2564</b>	<b>71</b>	<b>71</b>	<b>3560</b>	<b>3524</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.