

Fecha de Publicación: 14 de septiembre de 2016

Fecha de Información: 12 de septiembre de lunes <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\$1779.3 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 7.0%.<sup>2</sup>

**Cuadro No. 1**  
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero**		Intragrupa y Off-shore***		Otros Agentes		Interbancarios
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	254.1	480.6	197.6	18.3	133.0	85.8	150.0
15-35	652.2	559.7	189.0	180.9	111.7	212.3	259.0
36-60	3.1	23.4	10.0	0.0	13.4	3.1	0.0
61-90	0.8	3.8	0.0	0.0	3.8	0.8	0.0
91-180	86.1	15.1	1.7	76.0	13.4	10.1	0.0
>180	59.0	50.3	0.0	0.0	50.3	59.0	0.0
<b>Total</b>	<b>1055.3</b>	<b>1133.0</b>	<b>398.3</b>	<b>275.2</b>	<b>325.7</b>	<b>371.1</b>	<b>409.0</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 intragrupo		Total
	Compras/Ventas	Compras	Ventas	
3-14	4.5 %	7.8 %	5.7 %	6.5 %
15-35	7.1 %	7.5 %	7.4 %	7.3 %
36-60	-	7.6 %	6.6 %	7.5 %
61-90	-	7.0 %	6.4 %	6.9 %
91-180	-	6.7 %	6.8 %	6.8 %
>180	-	6.4 %	6.3 %	6.3 %
<b>Total</b>	<b>6.1 %</b>	<b>7.5 %</b>	<b>6.9 %</b>	<b>7.0 %</b>

\* Incluye solo operaciones interbancarias

En el cuadro No. 3 se presentan los vencimientos de forwards para ésta y las próximas dos semanas.

**Cuadro No. 3**  
Vencimientos de Forwards

Sector	12 al 16 de septiembre												19 al 23 de septiembre				26 al 30 de septiembre			
	Delivery				NDF				Delivery		NDF		Delivery		NDF					
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V						
Sector Financiero**	25	149	4366	4009	21	125	3707	3227	17	143	2690	2909								
Intragrupa y off-shore***	0	0	1659	1420	0	0	1681	1546	0	0	1388	913								
Otros	149	25	1397	1993	125	21	687	1302	143	17	804	1061								
<b>Total</b>	<b>174</b>	<b>174</b>	<b>7421</b>	<b>7421</b>	<b>147</b>	<b>147</b>	<b>6075</b>	<b>6075</b>	<b>160</b>	<b>160</b>	<b>4882</b>	<b>4882</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.

<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.