

Fecha de Publicación: 20 de septiembre de 2016

Fecha de Información: 16 de septiembre de viernes <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\$1300.6 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 6.7%.<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	250.1	196.4	63.5	134.0	73.9	57.1	59.0
15-35	390.5	287.9	133.6	156.3	80.8	160.6	73.5
36-60	34.2	4.5	0.0	0.0	4.5	34.2	0.0
61-90	1.5	28.3	15.3	0.0	13.0	1.5	0.0
91-180	57.1	28.0	12.6	20.0	5.4	27.1	10.0
>180	45.5	129.1	85.0	0.0	34.1	35.5	10.0
<b>Total</b>	<b>778.8</b>	<b>674.2</b>	<b>309.9</b>	<b>310.3</b>	<b>211.8</b>	<b>316.0</b>	<b>152.5</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	7.6 %	6.3 %	4.5 %	5.7 %
15-35	7.5 %	7.6 %	7.2 %	7.4 %
36-60	-	8.0 %	7.2 %	7.3 %
61-90	-	7.0 %	6.3 %	6.9 %
91-180	6.9 %	7.1 %	6.6 %	6.7 %
>180	6.5 %	6.3 %	6.0 %	6.2 %
<b>Total</b>	<b>7.5 %</b>	<b>6.9 %</b>	<b>6.4 %</b>	<b>6.7 %</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
Sector Financiero**	23	137	4830	4413	81	131	4242	3999	17	144	3086	3273
Intragrupa y off-shore***	0	0	1863	1779	0	55	2182	1838	0	0	1537	1074
Otros	137	23	1499	2001	131	26	825	1412	144	17	886	1163
<b>Total</b>	<b>160</b>	<b>160</b>	<b>8192</b>	<b>8192</b>	<b>213</b>	<b>213</b>	<b>7249</b>	<b>7249</b>	<b>161</b>	<b>161</b>	<b>5510</b>	<b>5510</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.