

Fecha de Publicación: 22 de septiembre de 2016

Fecha de Información: 20 de septiembre de martes <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\$1610.0 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 6.5%.<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         | 483.3               | 442.3        | 210.6                     | 226.5        | 131.9         | 156.9        | 99.9           |
| 15-35        | 409.5               | 291.1        | 127.2                     | 128.8        | 39.7          | 156.5        | 124.3          |
| 36-60        | 17.6                | 7.5          | 0.0                       | 0.0          | 7.5           | 17.6         | 0.0            |
| 61-90        | 2.5                 | 9.2          | 0.3                       | 0.0          | 8.9           | 2.5          | 0.0            |
| 91-180       | 2.8                 | 10.4         | 0.0                       | 0.0          | 10.4          | 2.8          | 0.0            |
| >180         | 84.3                | 79.6         | 10.0                      | 0.0          | 63.6          | 78.3         | 6.0            |
| <b>Total</b> | <b>1000.0</b>       | <b>840.1</b> | <b>348.1</b>              | <b>355.3</b> | <b>262.0</b>  | <b>414.6</b> | <b>230.1</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         | 4.2 %              | 6.6 %                        | 6.3 %        | 6.1 %        |
| 15-35        | 7.3 %              | 6.9 %                        | 7.0 %        | 7.0 %        |
| 36-60        | -                  | 7.3 %                        | 7.0 %        | 7.1 %        |
| 61-90        | -                  | 7.1 %                        | 6.3 %        | 6.9 %        |
| 91-180       | -                  | 6.8 %                        | 5.7 %        | 6.6 %        |
| >180         | 5.8 %              | 6.3 %                        | 6.2 %        | 6.3 %        |
| <b>Total</b> | <b>5.9 %</b>       | <b>6.7 %</b>                 | <b>6.5 %</b> | <b>6.5 %</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:  $((\text{Tasa Pactada/Tasa de Contado}) \wedge (360/\text{Plazo})) - 1$ . Para el cálculo de la devaluación implícita se excluyen las operaciones intragrupo.

**Cuadro No. 3**  
**Vencimientos de Forwards**

| Sectores                          | 19 al 23 de septiembre |            |             |             | 26 al 30 de septiembre |            |             |             | 3 al 7 de octubre |            |             |             |
|-----------------------------------|------------------------|------------|-------------|-------------|------------------------|------------|-------------|-------------|-------------------|------------|-------------|-------------|
|                                   | Delivery               |            | NDF         |             | Delivery               |            | NDF         |             | Delivery          |            | NDF         |             |
|                                   | C                      | V          | C           | V           | C                      | V          | C           | V           | C                 | V          | C           | V           |
| <b>Sector Financiero**</b>        | 80                     | 126        | 4568        | 4426        | 20                     | 143        | 3447        | 3560        | 19                | 128        | 3062        | 2738        |
| <b>Intragruppo y off-shore***</b> | 0                      | 55         | 2430        | 2020        | 0                      | 0          | 1678        | 1277        | 0                 | 0          | 1432        | 1156        |
| <b>Otros</b>                      | 126                    | 25         | 915         | 1466        | 143                    | 20         | 987         | 1275        | 127               | 19         | 507         | 1101        |
| <b>Total</b>                      | <b>206</b>             | <b>206</b> | <b>7912</b> | <b>7912</b> | <b>164</b>             | <b>164</b> | <b>6112</b> | <b>6112</b> | <b>146</b>        | <b>146</b> | <b>5000</b> | <b>4994</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.