

Fecha de Publicación: 23 de septiembre de 2016

Fecha de Información: 21 de septiembre de miércoles <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\$1697.6 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 6.4%.<sup>2</sup>

Cuadro No. 1  
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero**		Intragruppo y Off-shore***		Otros Agentes		Interbancarios
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	488.0	235.5	68.8	352.8	97.4	65.9	69.3
15-35	497.2	396.7	221.8	132.8	64.0	253.4	111.0
36-60	5.9	11.7	0.0	0.0	11.7	5.9	0.0
61-90	0.4	28.8	10.0	0.0	18.8	0.4	0.0
91-180	0.2	20.6	0.0	0.0	20.6	0.2	0.0
>180	61.1	131.9	60.0	0.0	71.9	61.1	0.0
<b>Total</b>	<b>1052.8</b>	<b>825.1</b>	<b>360.6</b>	<b>485.6</b>	<b>284.2</b>	<b>386.9</b>	<b>180.3</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 intragruppo		Total
	Compras/Ventas	Compras	Ventas	
3-14	4.5 %	6.9 %	5.7 %	5.9 %
15-35	7.0 %	6.8 %	6.6 %	6.7 %
36-60	-	7.6 %	7.0 %	7.4 %
61-90	-	7.2 %	6.5 %	7.2 %
91-180	-	6.9 %	6.2 %	6.9 %
>180	-	6.3 %	6.2 %	6.3 %
<b>Total</b>	<b>6.0 %</b>	<b>6.8 %</b>	<b>6.2 %</b>	<b>6.4 %</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 intragruppo.

**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>	79	126	4841	4537	21	144	3516	3619	20	129	3250	2903
<b>Intragruppo y off-shore***</b>	0	55	2451	2212	0	0	1725	1314	0	0	1488	1279
<b>Otros</b>	126	24	938	1481	144	21	995	1304	128	20	572	1122
<b>Total</b>	<b>205</b>	<b>205</b>	<b>8230</b>	<b>8230</b>	<b>165</b>	<b>165</b>	<b>6237</b>	<b>6237</b>	<b>148</b>	<b>148</b>	<b>5310</b>	<b>5304</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.