

Fecha de Publicación: 26 de septiembre de 2016

Fecha de Información: 22 de septiembre 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\$1818.6 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 6.8%.<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	532.3	240.8	54.0	237.2	57.8	166.0	129.0
15-35	361.6	503.7	347.6	200.7	85.1	89.9	71.0
36-60	0.2	18.9	0.0	0.0	18.9	0.2	0.0
61-90	3.2	21.5	0.0	0.3	21.5	3.0	0.0
91-180	26.5	48.4	0.0	0.0	48.4	26.5	0.0
>180	122.9	178.7	60.0	0.0	78.7	82.9	40.0
<b>Total</b>	<b>1046.7</b>	<b>1011.9</b>	<b>461.6</b>	<b>438.2</b>	<b>310.3</b>	<b>368.5</b>	<b>240.0</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	6.9 %	7.6 %	6.5 %	6.8 %
15-35	6.7 %	7.2 %	6.8 %	7.0 %
36-60	-	7.4 %	6.4 %	7.4 %
61-90	-	7.4 %	6.3 %	7.2 %
91-180	-	6.8 %	5.5 %	6.3 %
>180	5.9 %	6.1 %	6.1 %	6.1 %
<b>Total</b>	<b>6.7 %</b>	<b>7.1 %</b>	<b>6.5 %</b>	<b>6.8 %</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:  $((Tasa\ Pactada/Tasa\ de\ Contado) \wedge (360/Plazo)) - 1$ . 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>	79	127	5145	4600	21	134	3675	3755	20	131	3327	2955
<b>Intragruppo y off-shore***</b>	0	55	2465	2367	0	0	1761	1364	0	0	1499	1311
<b>Otros</b>	127	24	960	1603	134	21	1015	1332	131	20	592	1146
<b>Total</b>	<b>206</b>	<b>206</b>	<b>8570</b>	<b>8570</b>	<b>155</b>	<b>155</b>	<b>6451</b>	<b>6451</b>	<b>151</b>	<b>151</b>	<b>5418</b>	<b>5412</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.