

Fecha de Publicación: 4 de octubre de 2016

Fecha de Información: 30 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\$1277.8 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 6.3%.<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	306.6	281.9	91.6	71.1	85.3	130.5	105.0
15-35	267.6	294.4	125.8	107.1	97.5	89.4	71.1
36-60	18.8	51.3	20.0	0.0	31.3	18.8	0.0
61-90	51.4	86.9	0.0	0.0	86.9	51.4	0.0
91-180	0.2	21.2	0.0	0.0	21.2	0.2	0.0
>180	35.8	41.2	30.0	30.0	7.7	2.3	3.5
<b>Total</b>	<b>680.4</b>	<b>777.0</b>	<b>267.3</b>	<b>208.2</b>	<b>330.1</b>	<b>292.7</b>	<b>179.6</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	6.2 %	5.6 %	6.1 %	5.9 %
15-35	6.8 %	6.9 %	6.4 %	6.7 %
36-60	-	7.1 %	5.2 %	6.4 %
61-90	-	6.4 %	5.8 %	6.2 %
91-180	-	7.1 %	5.5 %	7.0 %
>180	5.8 %	6.8 %	5.8 %	6.1 %
<b>Total</b>	<b>6.4 %</b>	<b>6.4 %</b>	<b>6.1 %</b>	<b>6.3 %</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 intragrupo.

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

Sectores	26 al 30 de septiembre				3 al 7 de octubre				10 al 14 de octubre			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
<b>Sector Financiero**</b>	23	145	5007	4512	26	134	4330	3491	15	148	3017	2738
<b>Intragruppo y off-shore***</b>	0	0	2121	1982	0	0	1753	1508	0	0	1156	1038
<b>Otros</b>	145	23	1048	1682	133	26	685	1763	148	15	816	1212
<b>Total</b>	<b>168</b>	<b>168</b>	<b>8176</b>	<b>8176</b>	<b>160</b>	<b>160</b>	<b>6768</b>	<b>6762</b>	<b>163</b>	<b>163</b>	<b>4989</b>	<b>4989</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.