

**Fecha de Publicación: 30 de noviembre de 2016**

**Fecha de Información: 28 de noviembre de lunes <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\$1617.9 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 7.4%.<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	276.5	319.3	97.5	138.5	171.3	87.4	50.6
15-35	315.7	436.6	260.8	157.6	50.8	33.1	125.0
36-60	86.4	113.0	40.0	20.0	43.0	36.4	30.0
61-90	73.6	31.3	0.0	0.0	30.3	72.6	1.0
91-180	12.4	35.7	0.0	0.0	34.9	11.6	0.8
>180	57.5	67.1	0.0	0.0	67.1	57.5	0.0
<b>Total</b>	<b>822.2</b>	<b>1003.1</b>	<b>398.3</b>	<b>316.1</b>	<b>397.4</b>	<b>298.7</b>	<b>207.4</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	8.5 %	8.4 %	7.3 %	8.0 %
15-35	6.8 %	8.1 %	7.6 %	7.7 %
36-60	6.9 %	6.8 %	6.8 %	6.8 %
61-90	6.6 %	6.8 %	6.0 %	6.2 %
91-180	6.5 %	6.2 %	5.8 %	6.1 %
>180	-	5.7 %	5.6 %	5.7 %
<b>Total</b>	<b>7.2 %</b>	<b>7.7 %</b>	<b>7.0 %</b>	<b>7.4 %</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:  $((Tasa\ Pactada / Tasa\ de\ Contado) \wedge (360 / Plazo)) - 1$ . Para el cálculo de la devaluación implícita se excluyen las operaciones intragrupo.

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

Sectores	28 de nov. al 2 de diciembre				5 al 9 de diciembre				12 al 16 de diciembre			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
<b>Sector Financiero**</b>	46	123	3262	4142	24	81	2184	2439	47	120	2597	3001
<b>Intragrupa y off-shore***</b>	0	0	2147	1078	0	0	1178	950	0	0	1393	1116
<b>Otros</b>	123	46	969	1159	81	24	761	735	120	47	1031	895
<b>Total</b>	<b>169</b>	<b>169</b>	<b>6378</b>	<b>6378</b>	<b>105</b>	<b>105</b>	<b>4124</b>	<b>4124</b>	<b>168</b>	<b>168</b>	<b>5022</b>	<b>5012</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.