

Fecha de Publicación: 29 de septiembre de 2016

Fecha de Información: 27 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\$1326.9 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 6.7%.<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	340.2	120.0	28.2	113.0	22.8	158.2	69.0
15-35	483.3	355.8	143.7	230.6	76.2	116.7	136.0
36-60	15.9	19.1	4.8	0.0	4.3	5.9	10.0
61-90	26.3	4.0	0.0	0.0	4.0	26.3	0.0
91-180	2.4	17.0	0.0	0.0	14.7	0.1	2.3
>180	35.2	126.0	85.0	0.0	39.9	34.1	1.1
<b>Total</b>	<b>903.3</b>	<b>642.0</b>	<b>261.7</b>	<b>343.6</b>	<b>161.9</b>	<b>341.4</b>	<b>218.4</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	6.3 %	6.8 %	6.6 %	6.5 %
15-35	6.7 %	7.0 %	7.2 %	7.1 %
36-60	6.4 %	6.8 %	6.5 %	6.5 %
61-90	-	7.5 %	6.2 %	6.4 %
91-180	6.4 %	6.6 %	5.7 %	6.5 %
>180	6.2 %	5.8 %	5.8 %	5.8 %
<b>Total</b>	-	6.5 %	6.8 %	6.7 %

\*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	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>	24	146	4495	4399	20	133	3701	3100	12	145	2789	2390
<b>Intragruppo y off-shore***</b>	0	0	2098	1550	0	0	1526	1414	0	0	1070	1010
<b>Otros</b>	146	24	1032	1675	133	20	648	1355	145	12	624	1082
<b>Total</b>	<b>170</b>	<b>170</b>	<b>7624</b>	<b>7624</b>	<b>152</b>	<b>152</b>	<b>5875</b>	<b>5869</b>	<b>157</b>	<b>157</b>	<b>4483</b>	<b>4483</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.