

Fecha de Publicación: 3 de octubre de 2016

Fecha de Información: 29 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\$1779.7 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	445.9	314.0	113.7	129.0	122.3	238.8	78.0
15-35	544.3	478.9	166.0	206.5	149.4	174.3	163.5
36-60	6.8	46.8	25.0	0.0	21.8	6.8	0.0
61-90	57.5	77.4	10.0	0.0	67.4	57.5	0.0
91-180	1.8	21.5	0.0	0.0	21.5	1.8	0.0
>180	13.0	13.3	3.3	0.0	9.9	13.0	0.0
<b>Total</b>	<b>1069.3</b>	<b>951.9</b>	<b>318.0</b>	<b>335.5</b>	<b>392.3</b>	<b>492.3</b>	<b>241.5</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 %	7.6 %	5.6 %	6.4 %
15-35	6.1 %	6.7 %	6.2 %	6.3 %
36-60	-	7.2 %	4.4 %	6.8 %
61-90	-	6.5 %	6.2 %	6.4 %
91-180	-	6.4 %	6.1 %	6.4 %
>180	-	6.2 %	5.4 %	5.8 %
<b>Total</b>	<b>6.2 %</b>	<b>7.0 %</b>	<b>5.9 %</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 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>	22	146	5007	4512	25	135	4093	3328	15	148	2949	2620
<b>Intragruppo y off-shore***</b>	0	0	2121	1982	0	0	1690	1437	0	0	1127	1038
<b>Otros</b>	146	22	1048	1682	135	25	669	1682	148	15	746	1165
<b>Total</b>	<b>168</b>	<b>168</b>	<b>8176</b>	<b>8176</b>	<b>160</b>	<b>160</b>	<b>6452</b>	<b>6446</b>	<b>163</b>	<b>163</b>	<b>4822</b>	<b>4822</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.