

Fecha de Publicación: 15 de septiembre de 2016

Fecha de Información: 13 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\$2032.0 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 7.4%.<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	527.3	396.1	243.1	66.3	32.1	65.0
15-35	658.8	486.9	249.5	200.6	177.4	398.2	60.0
36-60	5.1	4.9	0.0	0.0	4.9	5.1	0.0
61-90	6.5	12.4	0.0	0.0	12.4	6.5	0.0
91-180	70.2	8.1	2.6	52.0	5.5	18.2	0.0
>180	31.8	19.8	0.2	0.0	4.6	16.8	15.0
<b>Total</b>	<b>1112.6</b>	<b>1059.3</b>	<b>648.3</b>	<b>495.7</b>	<b>271.0</b>	<b>477.0</b>	<b>140.0</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	7.3 %	7.6 %	7.0 %	7.4 %
15-35	7.5 %	8.0 %	7.3 %	7.6 %
36-60	-	7.8 %	6.8 %	7.3 %
61-90	-	7.6 %	6.6 %	7.2 %
91-180	-	7.4 %	6.4 %	6.5 %
>180	6.2 %	6.5 %	6.0 %	6.1 %
<b>Total</b>	<b>7.3 %</b>	<b>7.8 %</b>	<b>7.1 %</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:  $((\text{Tasa Pactada}/\text{Tasa de Contado}) \wedge (360/\text{Plazo})) - 1$ . Para el cálculo de la devaluación implícita se excluyen las operaciones intragrupo.

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

Sector	12 al 16 de septiembre				19 al 23 de septiembre				26 al 30 de septiembre			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
<b>Sector Financiero**</b>	23	151	4514	4243	22	127	3889	3491	17	143	2741	2981
<b>Intragruppo y off-shore***</b>	0	0	1820	1545	0	0	1897	1664	0	0	1450	925
<b>Otros</b>	151	23	1450	1997	127	21	691	1322	143	17	814	1100
<b>Total</b>	<b>175</b>	<b>175</b>	<b>7784</b>	<b>7784</b>	<b>149</b>	<b>149</b>	<b>6477</b>	<b>6477</b>	<b>160</b>	<b>160</b>	<b>5006</b>	<b>5006</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.