

**Fecha de Publicación: 11 de octubre de 2016**

**Fecha de Información: 07 de octubre 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\$958.2 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 7.2%.<sup>2</sup>

**Cuadro No. 1**  
**Contratos Forwards Pactados**

Rango	Sector Financiero**		Intragrupo y Off-shore***		Otros Agentes		Interbancarios
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	292.5	161.9	19.6	85.0	39.8	105.0	102.5
15-35	271.8	348.2	207.9	48.0	52.2	135.7	88.1
36-60	6.8	12.9	3.1	0.0	9.8	6.8	0.0
61-90	8.6	14.4	0.0	0.0	7.4	1.6	7.0
91-180	5.4	9.1	0.0	0.0	9.1	5.4	0.0
>180	21.9	2.2	0.0	20.0	2.2	1.9	0.0
<b>Total</b>	<b>607.0</b>	<b>548.8</b>	<b>230.5</b>	<b>153.0</b>	<b>120.6</b>	<b>256.4</b>	<b>197.6</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	7.4 %	7.3 %	6.9 %	7.1 %
15-35	7.4 %	7.5 %	7.1 %	7.3 %
36-60	-	7.5 %	6.1 %	7.0 %
61-90	6.3 %	7.4 %	5.8 %	6.7 %
91-180	-	6.7 %	5.8 %	6.4 %
>180	-	6.6 %	5.9 %	6.0 %
<b>Total</b>	<b>7.4 %</b>	<b>7.4 %</b>	<b>6.9 %</b>	<b>7.2 %</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:  $((\text{Tasa Pactada}/\text{Tasa de Contado})^{\frac{360}{\text{Plazo}}}) - 1$ . Para el cálculo de la devaluación implícita se excluyen las operaciones intragrupo.

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

Sectores	3 al 7 de octubre				10 al 14 de octubre				17 al 21 de octubre			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
<b>Sector Financiero**</b>	26	128	5007	4000	22	153	3764	3347	16	96	2469	2043
<b>Intragruppo y off-shore***</b>	0	0	1999	1929	0	0	1504	1396	0	0	800	813
<b>Otros</b>	128	26	729	1800	153	22	991	1517	96	16	702	1114
<b>Total</b>	<b>154</b>	<b>154</b>	<b>7735</b>	<b>7729</b>	<b>175</b>	<b>175</b>	<b>6259</b>	<b>6259</b>	<b>113</b>	<b>113</b>	<b>3971</b>	<b>3971</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.