

**Fecha de Publicación: 19 de octubre de 2016**

**Fecha de Información: 14 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\$1046.3 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 6.0%.<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	189.5	144.6	65.0	53.5	18.7	75.0	61.0
15-35	304.9	249.4	94.4	114.5	90.0	125.4	65.0
36-60	5.7	10.1	0.0	4.9	10.1	0.7	0.0
61-90	1.7	39.0	30.0	0.0	9.0	1.7	0.0
91-180	132.2	19.9	0.0	43.2	19.9	89.0	0.0
>180	70.9	4.5	0.0	0.0	4.5	70.9	0.0
<b>Total</b>	<b>704.8</b>	<b>467.6</b>	<b>189.3</b>	<b>216.2</b>	<b>152.2</b>	<b>362.6</b>	<b>126.0</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	
3-14	6.4 %	5.9 %	5.0 %	5.5 %
15-35	6.3 %	6.6 %	6.4 %	6.5 %
36-60	-	6.6 %	5.4 %	6.5 %
61-90	-	6.3 %	5.4 %	6.3 %
91-180	-	4.4 %	5.5 %	5.3 %
>180	-	6.5 %	5.2 %	5.3 %
<b>Total</b>	<b>6.3 %</b>	<b>6.3 %</b>	<b>5.7 %</b>	<b>6.0 %</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) ^ (360/Plazo)) - 1. Para el cálculo de la devaluación implícita se excluyen las operaciones intragrupo.

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

Sectores	10 al 14 de octubre				17 al 21 de octubre				24 al 28 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	143	4337	3713	34	103	2846	2422	43	149	3354	2996
<b>Intragrupo y off-shore***</b>	0	0	1663	1704	0	0	1011	953	0	0	1558	1393
Otros	142	24	995	1578	103	34	768	1250	149	43	715	1220
Total	<b>167</b>	<b>167</b>	<b>6995</b>	<b>6995</b>	<b>136</b>	<b>136</b>	<b>4625</b>	<b>4625</b>	<b>192</b>	<b>192</b>	<b>5627</b>	<b>5609</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.