

**Fecha de Publicación: 28 de octubre de 2016**

**Fecha de Información: 26 de octubre de miércoles <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\$1694.3 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 6.2%.<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	289.8	213.1	77.2	136.4	62.4	79.8	73.5
15-35	530.4	481.7	272.9	168.3	64.3	217.6	144.5
36-60	54.0	63.7	23.1	4.0	33.1	42.6	7.4
61-90	86.5	6.1	0.0	29.7	6.1	56.9	0.0
91-180	33.2	13.5	4.0	20.0	9.5	13.2	0.0
>180	118.7	84.0	0.0	57.0	29.0	6.7	55.0
<b>Total</b>	<b>1112.6</b>	<b>862.1</b>	<b>377.3</b>	<b>415.4</b>	<b>204.4</b>	<b>416.7</b>	<b>280.4</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	
3-14	5.6 %	6.6 %	6.1 %	6.2 %
15-35	6.4 %	6.7 %	6.4 %	6.5 %
36-60	5.8 %	5.9 %	5.6 %	5.7 %
61-90	-	5.4 %	5.0 %	5.0 %
91-180	-	6.0 %	5.1 %	5.5 %
>180	5.7 %	5.9 %	5.7 %	5.8 %
<b>Total</b>	<b>6.0 %</b>	<b>6.5 %</b>	<b>6.1 %</b>	<b>6.2 %</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:  $((Tasa\ Pactada/Tasa\ de\ Contado)^{(360/Plazo)} - 1)$ . Para el cálculo de la devaluación implícita se excluyen las operaciones intragrupo.

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

Sectores	24 al 28 de octubre				31 de oct. al 4 de noviembre				7 al 11 de noviembre			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
<b>Sector Financiero**</b>	55	147	4438	3665	26	102	3479	2936	29	79	2138	1977
<b>Intragrupo y off-shore***</b>	0	0	1876	2061	0	0	1287	1442	0	0	874	774
Otros	147	55	807	1377	101	26	792	1181	79	29	697	958
Total	<b>202</b>	<b>202</b>	<b>7121</b>	<b>7103</b>	<b>128</b>	<b>128</b>	<b>5558</b>	<b>5558</b>	<b>108</b>	<b>108</b>	<b>3709</b>	<b>3709</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.