

**Fecha de Publicación: 1 de noviembre de 2016**

**Fecha de Información: 28 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\$1251.7 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 6.2%.<sup>2</sup>

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

Rango	Sector Financiero**		Intragruo y Off-shore***		Otros Agentes		Interbancarios
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	203.7	190.2	85.8	62.5	29.4	66.2	75.0
15-35	394.7	350.0	213.8	71.0	81.3	268.7	55.0
36-60	68.4	47.1	0.0	0.0	47.1	68.4	0.0
61-90	33.3	20.0	0.0	5.0	15.0	23.3	5.0
91-180	15.3	33.6	20.0	0.0	13.6	15.3	0.0
>180	25.0	5.4	0.0	15.0	5.4	10.0	0.0
<b>Total</b>	<b>740.4</b>	<b>646.3</b>	<b>319.6</b>	<b>153.5</b>	<b>191.8</b>	<b>451.9</b>	<b>135.0</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 intragruo		Total
		Compras	Ventas	
3-14	6.2 %	5.3 %	5.0 %	5.4 %
15-35	6.1 %	7.4 %	6.0 %	6.6 %
36-60	-	6.3 %	6.0 %	6.1 %
61-90	6.0 %	5.9 %	5.3 %	5.6 %
91-180	-	5.9 %	5.4 %	5.7 %
>180	-	6.1 %	5.3 %	5.6 %
<b>Total</b>	<b>6.2 %</b>	<b>6.6 %</b>	<b>5.8 %</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:  $((\text{Tasa Pactada}/\text{Tasa de Contado})^{\frac{1}{360/\text{Plazo}}}) - 1$ . Para el cálculo de la devaluación implícita se excluyen las operaciones intragruo.

**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	150	4597	3728	31	104	3709	3121	32	77	2270	2109
<b>Intragrupo y off-shore***</b>	0	0	1922	2181	0	0	1373	1550	0	0	940	816
<b>Otros</b>	150	55	816	1409	104	31	810	1222	76	32	717	1003
<b>Total</b>	<b>205</b>	<b>205</b>	<b>7336</b>	<b>7318</b>	<b>135</b>	<b>135</b>	<b>5893</b>	<b>5893</b>	<b>108</b>	<b>108</b>	<b>3928</b>	<b>3928</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.