

**Fecha de Publicación: 16 de noviembre de 2016**

**Fecha de Información: 11 de noviembre 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\$933.9 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 5.5%.<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	204.0	218.8	166.9	148.0	6.9	11.0	45.0
15-35	117.2	322.1	253.3	31.8	4.8	21.4	64.0
36-60	20.7	3.3	0.0	0.0	3.3	20.7	0.0
61-90	8.5	16.9	0.0	0.0	16.9	8.5	0.0
91-180	9.4	4.3	0.0	0.0	4.3	9.4	0.0
>180	12.6	105.1	102.6	0.0	2.6	12.6	0.0
<b>Total</b>	<b>372.3</b>	<b>670.5</b>	<b>522.7</b>	<b>179.8</b>	<b>38.8</b>	<b>83.5</b>	<b>109.0</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	6.1 %	6.5 %	4.9 %	6.0 %
15-35	4.9 %	5.6 %	4.7 %	5.3 %
36-60	-	7.8 %	4.1 %	4.6 %
61-90	-	5.6 %	4.9 %	5.3 %
91-180	-	5.8 %	4.9 %	5.1 %
>180	-	6.5 %	5.0 %	5.2 %
<b>Total</b>	<b>5.4 %</b>	<b>5.9 %</b>	<b>4.8 %</b>	<b>5.5 %</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 intragruo.

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

Sectores	7 al 11 de noviembre				14 al 18 de noviembre				21 al 25 de noviembre			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
<b>Sector Financiero**</b>	37	83	2838	2650	45	97	2644	2664	53	114	2015	2649
<b>Intragrupo y off-shore***</b>	0	0	1221	1057	0	0	1387	1143	0	0	1424	515
<b>Otros</b>	83	37	764	1115	97	45	725	950	114	53	561	836
<b>Total</b>	<b>120</b>	<b>120</b>	<b>4823</b>	<b>4823</b>	<b>142</b>	<b>142</b>	<b>4757</b>	<b>4757</b>	<b>168</b>	<b>168</b>	<b>4000</b>	<b>4000</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.