

Fecha de Publicación: 5 de octubre de 2016

Fecha de Información: 03 de octubre de lunes <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\$1356.0 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 6.6%.<sup>2</sup>

Cuadro No. 1  
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero**		Intragruppo y Off-shore***		Otros Agentes		Interbancarios
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	180.3	190.9	93.5	50.5	19.4	51.8	78.0
15-35	469.3	405.8	182.2	137.8	122.5	230.6	101.0
36-60	21.9	41.8	0.0	13.0	41.8	8.9	0.0
61-90	14.6	14.0	0.6	0.0	13.4	14.6	0.0
91-180	17.0	10.1	0.0	0.0	10.1	17.0	0.0
>180	135.6	93.7	0.0	0.0	33.7	75.6	60.0
<b>Total</b>	<b>838.7</b>	<b>756.2</b>	<b>276.3</b>	<b>201.3</b>	<b>240.9</b>	<b>398.5</b>	<b>239.0</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	Compras	Ventas	
3-14	7.7 %	7.4 %	6.1 %	7.0 %
15-35	5.8 %	6.8 %	7.0 %	6.7 %
36-60	-	6.8 %	6.9 %	6.8 %
61-90	-	6.7 %	6.0 %	6.3 %
91-180	-	6.3 %	5.7 %	5.9 %
>180	5.8 %	5.9 %	5.6 %	5.7 %
<b>Total</b>	<b>6.4 %</b>	<b>6.8 %</b>	<b>6.6 %</b>	<b>6.6 %</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:  $((\text{Tasa Pactada}/\text{Tasa de Contado}) \wedge (360/\text{Plazo})) - 1$ . 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>	27	138	4480	3675	16	149	3047	2754	16	96	2089	1707
<b>Intragruppo y off-shore***</b>	0	0	1840	1558	0	0	1162	1039	0	0	689	728
<b>Otros</b>	138	27	702	1784	149	16	825	1242	96	16	573	915
<b>Total</b>	<b>165</b>	<b>165</b>	<b>7023</b>	<b>7017</b>	<b>165</b>	<b>165</b>	<b>5034</b>	<b>5034</b>	<b>112</b>	<b>112</b>	<b>3350</b>	<b>3350</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.