

Fecha de Publicación: 6 de octubre de 2016

Fecha de Información: 04 de octubre de martes <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\$1829.7 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 6.4%.<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	446.5	373.8	264.6	253.3	39.7	123.6	69.5
15-35	499.5	498.5	207.3	132.0	101.3	177.5	190.0
36-60	11.9	5.5	1.9	1.0	3.6	10.9	0.0
61-90	10.8	6.5	0.0	2.5	6.1	8.0	0.4
91-180	26.6	16.4	1.5	0.0	14.9	26.6	0.0
>180	122.8	140.8	43.0	0.0	27.8	52.8	70.0
<b>Total</b>	<b>1118.0</b>	<b>1041.5</b>	<b>518.3</b>	<b>388.8</b>	<b>193.4</b>	<b>399.4</b>	<b>329.9</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	9.6 %	3.8 %	6.5 %	5.7 %
15-35	7.4 %	7.3 %	7.0 %	7.2 %
36-60	-	6.9 %	6.6 %	6.7 %
61-90	6.2 %	6.7 %	5.9 %	6.3 %
91-180	-	6.5 %	5.7 %	6.0 %
>180	5.9 %	5.8 %	5.6 %	5.8 %
<b>Total</b>	<b>7.5 %</b>	<b>5.6 %</b>	<b>6.6 %</b>	<b>6.4 %</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	130	4660	3823	17	149	3280	2945	16	96	2180	1843
<b>Intragruppo y off-shore***</b>	0	0	1917	1680	0	0	1314	1170	0	0	767	728
<b>Otros</b>	130	27	722	1790	149	17	848	1327	96	16	598	974
<b>Total</b>	<b>157</b>	<b>157</b>	<b>7298</b>	<b>7292</b>	<b>166</b>	<b>166</b>	<b>5442</b>	<b>5442</b>	<b>112</b>	<b>112</b>	<b>3545</b>	<b>3545</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.