

Fecha de Publicación: 12 de octubre de 2016

Fecha de Información: 10 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\$186.9 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 6.0%.<sup>2</sup>

Cuadro No. 1  
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero**		Intragrupa y Off-shore***		Otros Agentes		Interbancarios
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	39.0	26.9	0.1	2.0	11.8	22.0	15.0
15-35	81.3	24.6	13.0	78.5	11.6	2.8	0.0
36-60	0.3	3.6	0.0	0.0	3.6	0.2	0.0
61-90	1.1	15.7	10.0	1.0	5.7	0.1	0.0
91-180	0.2	6.7	0.0	0.0	6.7	0.2	0.0
>180	0.6	2.0	0.0	0.0	2.0	0.6	0.0
<b>Total</b>	<b>122.4</b>	<b>79.6</b>	<b>23.1</b>	<b>81.5</b>	<b>41.4</b>	<b>25.9</b>	<b>15.0</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	3.2 %	6.8 %	3.6 %	4.2 %
15-35	-	7.3 %	6.8 %	7.0 %
36-60	6.5 %	7.3 %	5.3 %	7.2 %
61-90	-	6.7 %	6.0 %	6.6 %
91-180	-	6.6 %	5.7 %	6.6 %
>180	-	7.2 %	6.0 %	6.9 %
<b>Total</b>	<b>3.2 %</b>	<b>7.1 %</b>	<b>5.7 %</b>	<b>6.0 %</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	10 al 14 de octubre				17 al 21 de octubre				24 al 28 de octubre			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
<b>Sector Financiero**</b>	23	152	3802	3363	18	97	2469	2049	33	149	2655	2533
<b>Intragruppo y off-shore***</b>	0	0	1504	1398	0	0	800	813	0	0	1299	979
<b>Otros</b>	152	23	992	1537	97	18	707	1114	149	33	655	1079
<b>Total</b>	<b>174</b>	<b>174</b>	<b>6298</b>	<b>6298</b>	<b>115</b>	<b>115</b>	<b>3976</b>	<b>3976</b>	<b>183</b>	<b>183</b>	<b>4609</b>	<b>4591</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.