

Fecha de Publicación: 18 de octubre de 2016

Fecha de Información: 13 de octubre de jueves <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\$1654.1 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 6.7%.<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	469.4	332.4	160.6	245.5	54.1	106.2	117.8
15-35	480.8	497.2	278.5	212.3	90.7	140.5	128.0
36-60	7.4	3.8	0.0	0.0	3.8	7.4	0.0
61-90	9.3	9.1	0.0	0.0	3.1	3.3	6.0
91-180	45.3	18.7	10.0	0.0	8.7	45.3	0.0
>180	16.4	16.0	15.0	15.0	1.0	1.4	0.0
<b>Total</b>	<b>1028.6</b>	<b>877.3</b>	<b>464.1</b>	<b>472.8</b>	<b>161.5</b>	<b>304.1</b>	<b>251.8</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	4.8 %	7.2 %	6.7 %	6.5 %
15-35	5.9 %	7.3 %	7.0 %	6.9 %
36-60	-	8.7 %	6.4 %	7.2 %
61-90	6.4 %	6.6 %	6.1 %	6.4 %
91-180	-	6.4 %	5.7 %	5.9 %
>180	-	6.5 %	5.4 %	5.9 %
<b>Total</b>	<b>5.4 %</b>	<b>7.2 %</b>	<b>6.8 %</b>	<b>6.7 %</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>	24	152	4337	3713	29	100	2768	2346	42	149	3249	2939
<b>Intragruppo y off-shore***</b>	0	0	1663	1704	0	0	959	907	0	0	1545	1386
<b>Otros</b>	152	24	996	1578	100	29	771	1245	149	42	705	1156
<b>Total</b>	<b>176</b>	<b>176</b>	<b>6995</b>	<b>6995</b>	<b>129</b>	<b>129</b>	<b>4498</b>	<b>4498</b>	<b>192</b>	<b>192</b>	<b>5499</b>	<b>5481</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.