

Fecha de Publicación: 21 de octubre de 2016

Fecha de Información: 19 de octubre de miércoles <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\$1546.5 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 5.7%.<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	384.9	154.5	68.0	272.3	16.5	42.7	70.0
15-35	379.4	444.7	249.8	153.3	114.4	145.6	80.5
36-60	4.3	51.6	45.0	0.0	6.6	4.3	0.0
61-90	60.9	4.6	0.0	45.0	4.6	15.9	0.0
91-180	1.0	30.1	10.0	0.0	20.1	1.0	0.0
>180	96.5	90.5	20.0	25.2	64.5	65.3	6.0
<b>Total</b>	<b>927.0</b>	<b>776.1</b>	<b>392.8</b>	<b>495.7</b>	<b>226.8</b>	<b>274.8</b>	<b>156.5</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	4.3 %	5.2 %	5.4 %	5.2 %
15-35	6.7 %	6.4 %	5.5 %	6.0 %
36-60	-	4.5 %	5.7 %	4.7 %
61-90	-	11.7 %	3.1 %	4.2 %
91-180	-	5.9 %	5.5 %	5.9 %
>180	5.6 %	5.7 %	5.9 %	5.8 %
<b>Total</b>	<b>5.6 %</b>	<b>6.0 %</b>	<b>5.4 %</b>	<b>5.7 %</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	17 al 21 de octubre				24 al 28 de octubre				31 de oct. al 4 de noviembre			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
<b>Sector Financiero**</b>	29	116	3175	2561	49	147	3581	3180	18	97	2884	2683
<b>Intragruppo y off-shore***</b>	0	0	1068	1177	0	0	1665	1527	0	0	1205	1101
<b>Otros</b>	116	29	769	1273	147	49	772	1292	97	18	751	1056
<b>Total</b>	<b>145</b>	<b>145</b>	<b>5011</b>	<b>5011</b>	<b>196</b>	<b>196</b>	<b>6017</b>	<b>5999</b>	<b>114</b>	<b>114</b>	<b>4841</b>	<b>4841</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.