

Fecha de Publicación: 26 de octubre de 2016

Fecha de Información: 24 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\$1202.5 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	324.3	220.8	56.3	156.4	22.9	26.3	141.7
15-35	260.2	237.7	138.0	65.0	15.7	111.2	84.0
36-60	134.0	130.2	15.0	22.0	107.2	104.0	8.0
61-90	20.6	13.2	0.0	0.0	13.2	20.6	0.0
91-180	6.2	33.2	0.2	0.0	33.1	6.2	0.0
>180	33.8	22.1	20.0	11.5	2.1	22.3	0.0
<b>Total</b>	<b>779.0</b>	<b>657.1</b>	<b>229.5</b>	<b>254.9</b>	<b>194.0</b>	<b>290.5</b>	<b>233.7</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	6.3 %	5.2 %	5.8 %	5.9 %
15-35	6.4 %	6.6 %	6.2 %	6.4 %
36-60	5.3 %	5.8 %	5.8 %	5.8 %
61-90	-	5.5 %	5.1 %	5.2 %
91-180	-	5.5 %	5.4 %	5.5 %
>180	-	5.7 %	5.7 %	5.7 %
<b>Total</b>	<b>6.3 %</b>	<b>6.0 %</b>	<b>5.9 %</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:  $((Tasa\ Pactada/Tasa\ de\ Contado) \wedge (360/Plazo)) - 1$ . Para el cálculo de la devaluación implícita se excluyen las operaciones intragrupo.

**Cuadro No. 3**  
**Vencimientos de Forwards**

Sectores	24 al 28 de octubre				31 de oct. al 4 de noviembre				7 al 11 de noviembre			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
<b>Sector Financiero**</b>	53	150	4162	3560	22	101	3365	2869	25	79	1793	1736
<b>Intragruppo y off-shore***</b>	0	0	1822	1847	0	0	1272	1358	0	0	764	699
<b>Otros</b>	150	53	806	1366	101	22	762	1172	79	25	644	765
<b>Total</b>	<b>204</b>	<b>204</b>	<b>6790</b>	<b>6772</b>	<b>123</b>	<b>123</b>	<b>5399</b>	<b>5399</b>	<b>104</b>	<b>104</b>	<b>3201</b>	<b>3201</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.