

**Fecha de Publicación: 15 de noviembre de 2016**

**Fecha de Información: 10 de noviembre 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\$1507.5 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 5.6%.<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	138.5	286.4	191.0	4.0	34.4	73.5	61.0
15-35	341.2	454.3	334.0	200.8	18.3	38.4	102.0
36-60	74.5	55.1	12.3	0.0	38.8	70.5	4.0
61-90	88.8	56.7	10.0	0.0	46.7	88.8	0.0
91-180	24.1	14.0	0.0	0.0	14.0	24.1	0.0
>180	21.2	119.8	115.0	0.2	4.8	21.0	0.0
<b>Total</b>	<b>688.2</b>	<b>986.3</b>	<b>662.3</b>	<b>205.0</b>	<b>157.0</b>	<b>316.2</b>	<b>167.0</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	6.0 %	5.9 %	5.0 %	5.7 %
15-35	5.7 %	6.1 %	5.7 %	5.9 %
36-60	6.0 %	5.9 %	5.2 %	5.5 %
61-90	-	5.5 %	5.1 %	5.2 %
91-180	-	5.6 %	4.9 %	5.2 %
>180	-	5.4 %	4.5 %	5.3 %
<b>Total</b>	-	5.8 %	5.3 %	5.6 %

\*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	7 al 11 de noviembre				14 al 18 de noviembre				21 al 25 de noviembre			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
<b>Sector Financiero**</b>	37	83	2838	2647	44	92	2449	2472	53	112	2008	2633
<b>Intragruppo y off-shore***</b>	0	0	1221	1057	0	0	1240	995	0	0	1405	515
<b>Otros</b>	83	37	761	1115	92	44	726	948	112	53	564	829
<b>Total</b>	<b>120</b>	<b>120</b>	<b>4820</b>	<b>4820</b>	<b>136</b>	<b>136</b>	<b>4415</b>	<b>4415</b>	<b>165</b>	<b>165</b>	<b>3977</b>	<b>3977</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.