

**Fecha de Publicación: 18 de noviembre de 2016**

**Fecha de Información: 16 de noviembre 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\$1504.9 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 6.2%.<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	191.8	291.7	109.1	36.0	90.4	63.6	92.2
15-35	421.6	395.5	151.8	176.5	115.7	117.1	128.0
36-60	51.5	81.9	15.0	5.0	26.9	6.5	40.0
61-90	29.6	38.6	0.0	0.0	17.6	8.6	21.0
91-180	124.4	191.9	20.0	4.5	92.8	40.8	79.1
>180	4.8	41.8	35.5	0.1	6.3	4.7	0.0
<b>Total</b>	<b>823.8</b>	<b>1041.4</b>	<b>331.3</b>	<b>222.1</b>	<b>349.8</b>	<b>241.4</b>	<b>360.3</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	6.5 %	6.9 %	5.9 %	6.5 %
15-35	6.6 %	6.4 %	6.2 %	6.3 %
36-60	5.8 %	6.6 %	5.9 %	6.1 %
61-90	5.7 %	5.5 %	5.4 %	5.6 %
91-180	5.5 %	5.7 %	5.1 %	5.5 %
>180	-	5.6 %	4.8 %	5.5 %
<b>Total</b>	<b>6.2 %</b>	<b>6.4 %</b>	<b>6.0 %</b>	<b>6.2 %</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	14 al 18 de noviembre				21 al 25 de noviembre				28 de nov. al 2 de diciembre			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
<b>Sector Financiero**</b>	45	98	2875	2929	55	121	2094	2816	21	122	2369	2571
<b>Intragruppo y off-shore***</b>	0	0	1517	1245	0	0	1509	526	0	0	1324	771
<b>Otros</b>	98	45	743	962	121	55	611	871	122	21	612	963
<b>Total</b>	<b>143</b>	<b>143</b>	<b>5135</b>	<b>5135</b>	<b>176</b>	<b>176</b>	<b>4213</b>	<b>4213</b>	<b>143</b>	<b>143</b>	<b>4305</b>	<b>4305</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.