

**Fecha de Publicación: 4 de mayo de 2016**

**Fecha de Información: 02 de mayo 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\$1055.1 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	232.2	191.0	100.8	72.0	53.2	123.2	37.0
15-35	256.8	187.1	73.2	71.3	19.9	91.6	94.0
36-60	101.6	104.7	0.0	0.0	104.7	101.6	0.0
61-90	0.4	9.0	0.0	0.0	9.0	0.4	0.0
91-180	36.3	30.3	0.0	0.0	30.3	36.3	0.0
>180	21.3	15.3	0.0	15.0	15.3	6.3	0.0
<b>Total</b>	<b>648.7</b>	<b>537.4</b>	<b>173.9</b>	<b>158.3</b>	<b>232.5</b>	<b>359.5</b>	<b>131.0</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	6.3 %	5.4 %	4.9 %	5.2 %
15-35	6.0 %	6.1 %	5.5 %	5.8 %
36-60	-	6.3 %	5.5 %	5.9 %
61-90	-	6.6 %	5.6 %	6.5 %
91-180	-	6.6 %	6.1 %	6.3 %
>180	-	6.6 %	6.3 %	6.4 %
<b>Total</b>	<b>6.1 %</b>	<b>5.9 %</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:  $((\text{Tasa Pactada} / \text{Tasa de Contado}) ^ {360 / \text{Plazo}}) - 1$ . Para el cálculo de la devaluación implícita se excluyen las operaciones intragrupo.

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

Sectores	2 al 6 de mayo				9 al 13 de mayo				16 al 20 de mayo			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
<b>Sector Financiero**</b>	414	166	4203	4184	14	135	2525	2515	23	140	2727	2237
<b>Intragruppo y off-shore***</b>	0	221	2194	1344	0	0	1081	694	0	0	1010	763
<b>Otros</b>	166	193	623	1491	135	14	693	1090	140	23	689	1423
<b>Total</b>	<b>579</b>	<b>579</b>	<b>7019</b>	<b>7019</b>	<b>149</b>	<b>149</b>	<b>4299</b>	<b>4299</b>	<b>164</b>	<b>164</b>	<b>4426</b>	<b>4423</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.