

**Fecha de Publicación: 5 de mayo de 2016**

**Fecha de Información: 03 de mayo de martes <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 6.0%.<sup>2</sup>

**Cuadro No. 1**  
**Contratos Forwards Pactados**

Rango	Sector Financiero**		Intragruppo y Off-shore***		Otros Agentes		Interbancarios
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	350.8	208.8	119.6	132.1	40.2	169.7	49.0
15-35	347.8	560.3	346.9	103.0	40.6	72.1	172.8
36-60	70.1	26.5	10.0	0.0	16.5	70.1	0.0
61-90	2.0	9.5	0.0	0.0	9.2	1.8	0.3
91-180	57.2	52.3	0.0	0.0	52.3	57.2	0.0
>180	31.8	32.9	10.0	0.0	2.4	11.3	20.5
<b>Total</b>	<b>859.8</b>	<b>890.3</b>	<b>486.5</b>	<b>235.1</b>	<b>161.3</b>	<b>382.2</b>	<b>242.5</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	3.3 %	5.9 %	5.8 %	5.6 %
15-35	6.5 %	6.4 %	6.2 %	6.4 %
36-60	-	6.7 %	6.0 %	6.2 %
61-90	6.3 %	7.0 %	5.9 %	6.8 %
91-180	-	6.0 %	5.9 %	5.9 %
>180	6.2 %	6.5 %	6.0 %	6.2 %
<b>Total</b>	<b>5.8 %</b>	<b>6.2 %</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:  $((\text{Tasa Pactada} / \text{Tasa de Contado}) ^ \wedge (360 / \text{Plazo})) - 1$ . Para el cálculo de la devaluación implícita se excluyen las operaciones intragrupo.

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

Sectores	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>	417	165	4243	4244	15	133	2609	2639	24	139	3022	2307
<b>Intragruppo y off-shore***</b>	0	221	2234	1344	0	0	1160	757	0	0	1014	832
<b>Otros</b>	165	196	622	1511	133	15	717	1090	139	24	728	1621
<b>Total</b>	<b>581</b>	<b>581</b>	<b>7099</b>	<b>7099</b>	<b>148</b>	<b>148</b>	<b>4486</b>	<b>4486</b>	<b>163</b>	<b>163</b>	<b>4764</b>	<b>4761</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.