

**Fecha de Publicación: 23 de mayo de 2016**

**Fecha de Información: 19 de mayo 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\$1814.8 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 7.6%.<sup>2</sup>

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

Rango	Sector Financiero**		Intragrupo y Off-shore***		Otros Agentes		Interbancarios
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	305.5	309.3	146.0	131.3	34.8	45.8	128.5
15-35	583.9	598.9	348.9	89.3	60.1	304.7	190.0
36-60	38.0	11.3	0.0	0.0	11.3	38.0	0.0
61-90	2.6	33.3	0.0	0.0	33.3	2.6	0.0
91-180	105.6	138.9	21.5	0.0	87.4	75.6	30.0
>180	19.3	22.6	0.0	0.0	16.6	13.3	6.0
<b>Total</b>	<b>1055.0</b>	<b>1114.3</b>	<b>516.4</b>	<b>220.5</b>	<b>243.4</b>	<b>480.0</b>	<b>354.5</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	8.3 %	8.1 %	7.8 %	8.1 %
15-35	8.0 %	7.8 %	7.2 %	7.6 %
36-60	-	8.4 %	7.4 %	7.7 %
61-90	-	8.3 %	6.9 %	8.2 %
91-180	7.4 %	6.9 %	6.5 %	6.8 %
>180	6.0 %	6.7 %	6.0 %	6.3 %
<b>Total</b>	<b>8.0 %</b>	<b>7.8 %</b>	<b>7.3 %</b>	<b>7.6 %</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	16 al 20 de mayo				23 al 27 de mayo				30 de may. al 3 de junio			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
<b>Sector Financiero**</b>	21	135	4061	3589	20	125	3479	3825	20	106	2713	2498
<b>Intragrupo y off-shore***</b>	0	0	1903	1335	0	0	1702	782	0	0	1440	1014
<b>Otros</b>	135	21	866	1904	124	20	1089	1663	106	20	442	1078
<b>Total</b>	<b>156</b>	<b>156</b>	<b>6831</b>	<b>6828</b>	<b>144</b>	<b>144</b>	<b>6270</b>	<b>6270</b>	<b>125</b>	<b>125</b>	<b>4595</b>	<b>4590</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.