

**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       |              |
| 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:  $((Tasa\ Pactada/Tasa\ de\ Contado)^{(360/Plazo)} - 1)$ . 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        |
| Otros                            | 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.