

**Fecha de Publicación: 24 de mayo de 2016**

**Fecha de Información: 20 de mayo de viernes <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\$1081.0 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 7.2%.<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         | 303.0               | 180.7        | 121.4                      | 249.4        | 36.3          | 30.7         | 23.0           |
| 15-35        | 333.2               | 263.3        | 181.1                      | 103.2        | 23.2          | 171.0        | 59.0           |
| 36-60        | 1.5                 | 5.4          | 0.0                        | 0.0          | 5.4           | 1.5          | 0.0            |
| 61-90        | 0.2                 | 13.3         | 0.0                        | 0.0          | 13.3          | 0.2          | 0.0            |
| 91-180       | 11.0                | 58.9         | 0.0                        | 0.0          | 49.8          | 1.9          | 9.1            |
| >180         | 0.1                 | 1.6          | 0.0                        | 0.0          | 1.6           | 0.1          | 0.0            |
| <b>Total</b> | <b>648.9</b>        | <b>523.2</b> | <b>302.5</b>               | <b>352.6</b> | <b>129.6</b>  | <b>205.2</b> | <b>91.1</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         | 6.8 %              | 8.0 %                        | 6.3 %        | 7.0 %        |
| 15-35        | 7.6 %              | 7.7 %                        | 7.6 %        | 7.7 %        |
| 36-60        | -                  | 7.9 %                        | 7.0 %        | 7.7 %        |
| 61-90        | -                  | 7.7 %                        | 6.9 %        | 7.6 %        |
| 91-180       | 6.8 %              | 4.4 %                        | 4.6 %        | 4.8 %        |
| >180         | -                  | 7.3 %                        | 6.5 %        | 7.2 %        |
| <b>Total</b> | <b>7.3 %</b>       | <b>7.4 %</b>                 | <b>7.0 %</b> | <b>7.2 %</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:  $((\text{Tasa Pactada}/\text{Tasa de Contado})^{\frac{360}{\text{Plazo}}}) - 1$ . 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               | 123        | 4061        | 3590        | 19               | 129        | 3725        | 3907        | 20                       | 106        | 2770        | 2593        |
| <b>Intragrupo y off-shore***</b> | 0                | 0          | 1903        | 1335        | 0                | 0          | 1741        | 984         | 0                        | 0          | 1522        | 1062        |
| <b>Otros</b>                     | 123              | 21         | 867         | 1904        | 129              | 19         | 1108        | 1684        | 106                      | 20         | 455         | 1087        |
| <b>Total</b>                     | <b>144</b>       | <b>144</b> | <b>6832</b> | <b>6829</b> | <b>147</b>       | <b>148</b> | <b>6574</b> | <b>6574</b> | <b>125</b>               | <b>125</b> | <b>4747</b> | <b>4742</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.