

**Fecha de Publicación: 31 de mayo de 2016**

**Fecha de Información: 26 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\$1181.0 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 7.2%.<sup>2</sup>

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

Rango	Sector Financiero**		Intragrupo y Off-shore***		Otros Agentes		Interbancarios
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	181.8	65.8	3.0	117.5	50.8	52.3	12.0
15-35	321.0	385.4	219.5	49.5	81.1	186.7	84.8
36-60	3.6	49.6	0.0	0.0	49.6	3.6	0.0
61-90	34.6	80.0	20.0	0.0	60.0	34.6	0.0
91-180	58.4	67.9	10.2	20.0	57.7	38.4	0.0
>180	15.0	14.7	0.0	0.0	14.7	15.0	0.0
<b>Total</b>	<b>614.5</b>	<b>663.3</b>	<b>252.7</b>	<b>187.0</b>	<b>313.9</b>	<b>330.7</b>	<b>96.8</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	7.5 %	7.5 %	7.0 %	7.2 %
15-35	7.6 %	7.4 %	7.3 %	7.4 %
36-60	-	7.7 %	6.9 %	7.7 %
61-90	-	7.2 %	6.9 %	7.1 %
91-180	-	6.9 %	6.5 %	6.7 %
>180	-	6.9 %	6.3 %	6.6 %
<b>Total</b>	<b>7.6 %</b>	<b>7.3 %</b>	<b>7.1 %</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:  $((\text{Tasa Pactada/Tasa de Contado})^{\wedge} (360/\text{Plazo})) - 1$ . Para el cálculo de la devaluación implícita se excluyen las operaciones intragrupo.

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

Sectores	23 al 27 de mayo				30 de may. al 3 de junio				6 al 10 de junio			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
<b>Sector Financiero**</b>	40	123	4392	4110	21	96	2987	2894	6	78	2739	2263
<b>Intragruppo y off-shore***</b>	0	0	1813	1534	0	0	1717	1125	0	0	1104	1026
<b>Otros</b>	123	40	1164	1725	96	21	513	1193	78	6	565	1119
<b>Total</b>	<b>163</b>	<b>164</b>	<b>7368</b>	<b>7368</b>	<b>118</b>	<b>118</b>	<b>5216</b>	<b>5211</b>	<b>84</b>	<b>84</b>	<b>4408</b>	<b>4408</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.