

Fecha de Publicación: 12 de mayo de 2016

Fecha de Información: 10 de mayo de martes ¹

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Según el reporte de los Intermediarios del Mercado Cambiario durante el día se pactó un total de US\$1225.2 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 6.4%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero**		Intragrupo y Off-shore***		Otros Agentes		Interbancarios
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	237.3	286.4	137.2	45.8	62.6	104.9	86.6
15-35	402.0	347.6	151.5	130.5	76.1	151.4	120.0
36-60	20.8	68.5	0.0	17.8	68.5	3.0	0.0
61-90	8.1	32.8	0.0	0.0	32.8	8.1	0.0
91-180	1.1	18.8	0.0	0.0	18.8	1.1	0.0
>180	4.8	3.4	0.0	0.0	3.4	4.8	0.0
Total	674.0	757.7	288.7	194.1	262.4	273.4	206.6

* 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	6.6 %	6.8 %	5.6 %	6.4 %
15-35	4.7 %	7.2 %	6.3 %	6.3 %
36-60	-	6.8 %	6.4 %	6.7 %
61-90	-	7.4 %	6.3 %	7.2 %
91-180	-	7.0 %	6.2 %	6.9 %
>180	-	6.8 %	5.8 %	6.2 %
Total	5.5 %	7.0 %	6.1 %	6.4 %

*Incluye solo operaciones interbancarias

En el cuadro No. 3 se presentan los vencimientos de forwards para ésta y las próximas dos semanas.

¹ Datos provisionales.

² 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	9 al 13 de mayo				16 al 20 de mayo				23 al 27 de mayo			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	18	119	2935	3135	26	141	3327	2769	11	123	2665	2862
Intragruppo y off-shore***	0	0	1488	886	0	0	1320	880	0	0	1356	653
Otros	119	18	754	1156	141	26	797	1792	123	11	795	1300
Total	137	137	5177	5177	167	167	5443	5440	134	134	4815	4815

* 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.