

Fecha de Publicación: 16 de mayo de 2016

Fecha de Información: 12 de mayo de jueves 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\$1687.6 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 6.0%.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	446.4	456.3	258.7	230.9	125.0	143.0	72.5
15-35	434.2	374.8	295.5	156.9	18.3	216.3	61.0
36-60	16.9	48.3	0.0	0.0	33.3	1.9	15.0
61-90	1.3	17.2	10.0	0.0	7.2	1.3	0.0
91-180	1.4	20.1	10.0	0.0	10.1	1.4	0.0
>180	0.0	19.2	10.0	0.0	9.2	0.0	0.0
Total	900.2	935.9	584.2	387.8	203.2	363.9	148.5

* 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	5.2 %	6.3 %	5.4 %	5.7 %
15-35	6.7 %	6.0 %	6.0 %	6.1 %
36-60	6.6 %	7.1 %	6.8 %	6.9 %
61-90	-	7.0 %	6.1 %	7.0 %
91-180	-	7.1 %	6.3 %	7.1 %
>180	-	6.3 %	-	6.3 %
Total	6.0 %	6.3 %	5.7 %	6.0 %

*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: $((\text{Tasa Pactada}/\text{Tasa de Contado})^{\wedge} (360/\text{Plazo})) - 1$. 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	120	3362	3241	27	138	3580	3126	12	124	2927	3134
Intragrupo y off-shore***	0	0	1583	1291	0	0	1577	1016	0	0	1440	698
Otros	120	18	748	1160	138	27	845	1858	124	12	920	1455
Total	137	137	5693	5693	165	165	6002	5999	135	135	5287	5287

* 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.