

Fecha de Publicación: 17 de mayo de 2016

Fecha de Información: 13 de mayo de viernes 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\$1158.1 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 6.6%.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	203.4	300.7	148.5	13.5	37.2	74.9	115.0
15-35	253.8	298.9	237.8	71.4	27.1	148.5	33.9
36-60	11.0	33.4	0.0	0.0	33.4	11.0	0.0
61-90	4.8	15.5	0.0	0.0	15.5	4.8	0.0
91-180	142.1	24.4	0.0	50.0	14.4	82.1	10.0
>180	8.4	23.6	20.0	0.0	0.6	5.4	3.0
Total	623.5	696.6	406.3	134.9	128.3	326.7	161.9

* 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	6.9 %	7.2 %	4.7 %	6.5 %
15-35	6.3 %	6.5 %	6.8 %	6.6 %
36-60	-	7.2 %	6.4 %	7.0 %
61-90	-	7.0 %	6.5 %	6.9 %
91-180	6.9 %	7.6 %	6.6 %	6.7 %
>180	5.7 %	6.6 %	5.9 %	6.4 %
Total	6.8 %	6.8 %	6.4 %	6.6 %

*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: $((\text{Tasa Pactada/Tasa de Contado})^{\wedge} (360/\text{Plazo})) - 1$. 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	22	134	3681	3332	12	126	3025	3227
Intragrupo y off-shore***	0	0	1583	1291	0	0	1693	1028	0	0	1472	700
Otros	120	18	748	1160	134	22	861	1873	126	12	941	1511
Total	138	138	5693	5693	156	156	6235	6232	138	138	5438	5438

* 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.