

Fecha de Publicación: 19 de mayo de 2016

Fecha de Información: 17 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\$1346.4 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 7.2%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero**		Intragruppo y Off-shore***		Otros Agentes		Interbancarios
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	197.4	278.5	122.3	86.0	81.2	36.4	75.0
15-35	469.5	535.1	387.7	136.1	14.5	200.4	133.0
36-60	2.8	13.2	0.0	0.0	13.2	2.8	0.0
61-90	7.1	11.4	0.0	0.0	11.4	7.1	0.0
91-180	9.8	22.3	0.0	0.0	16.3	3.8	6.0
>180	13.2	0.2	0.0	0.0	0.2	13.2	0.0
Total	699.7	860.7	510.0	222.1	136.7	263.6	214.0

* 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 intragruppo		Total
	Compras/Ventas	Compras	Ventas	
3-14	7.6 %	7.1 %	2.7 %	6.0 %
15-35	7.6 %	8.2 %	7.1 %	7.7 %
36-60	-	7.3 %	6.0 %	7.0 %
61-90	-	7.5 %	6.6 %	7.2 %
91-180	7.0 %	7.5 %	6.1 %	7.2 %
>180	-	7.5 %	5.5 %	5.6 %
Total	7.6 %	7.8 %	6.0 %	7.2 %

*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 intragruppo.

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
Sector Financiero**	26	137	3868	3586	15	127	3232	3456	17	105	2509	2233
Intragruppo y off-shore***	0	0	1903	1144	0	0	1518	749	0	0	1329	969
Otros	137	26	863	1902	127	15	1041	1585	105	17	388	1018
Total	164	164	6634	6631	142	142	5790	5790	123	123	4226	4221

* 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.