

Fecha de Publicación: 24 de mayo de 2016

Fecha de Información: 20 de mayo de viernes¹

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Según el reporte de los Intermediarios del Mercado Cambiario durante el día se pactó un total de US\$1081.0 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 7.2%.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	303.0	180.7	121.4	249.4	36.3	30.7	23.0
15-35	333.2	263.3	181.1	103.2	23.2	171.0	59.0
36-60	1.5	5.4	0.0	0.0	5.4	1.5	0.0
61-90	0.2	13.3	0.0	0.0	13.3	0.2	0.0
91-180	11.0	58.9	0.0	0.0	49.8	1.9	9.1
>180	0.1	1.6	0.0	0.0	1.6	0.1	0.0
Total	648.9	523.2	302.5	352.6	129.6	205.2	91.1

* 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	
3-14	6.8 %	8.0 %	6.3 %	7.0 %
15-35	7.6 %	7.7 %	7.6 %	7.7 %
36-60	-	7.9 %	7.0 %	7.7 %
61-90	-	7.7 %	6.9 %	7.6 %
91-180	6.8 %	4.4 %	4.6 %	4.8 %
>180	-	7.3 %	6.5 %	7.2 %
Total	7.3 %	7.4 %	7.0 %	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: $((Tasa\ Pactada/Tasa\ de\ Contado)^{(360/Plazo)} - 1)$. Para el cálculo de la devaluación implícita se excluyen las operaciones intragrupo.

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**	21	123	4061	3590	19	129	3725	3907	20	106	2770	2593
Intragrupo y off-shore***	0	0	1903	1335	0	0	1741	984	0	0	1522	1062
Otros	123	21	867	1904	129	19	1108	1684	106	20	455	1087
Total	144	144	6832	6829	147	148	6574	6574	125	125	4747	4742

* 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.