

Fecha de Publicación: 25 de mayo de 2016

Fecha de Información: 23 de mayo de lunes 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\$1505.5 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 7.0%.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	240.8	198.3	97.0	127.0	56.3	68.8	45.0
15-35	362.0	522.9	340.0	76.0	96.4	199.5	86.5
36-60	42.6	33.8	10.0	40.5	23.8	2.1	0.0
61-90	12.3	0.8	0.0	0.0	0.8	12.3	0.0
91-180	128.2	88.7	0.0	0.0	88.7	128.2	0.0
>180	5.0	1.6	0.0	5.0	1.6	0.0	0.0
Total	790.9	846.0	447.0	248.5	267.5	410.9	131.5

* 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	6.4 %	7.3 %	4.6 %	5.9 %
15-35	7.6 %	7.7 %	7.5 %	7.6 %
36-60	-	7.6 %	7.4 %	7.5 %
61-90	-	7.8 %	7.0 %	7.0 %
91-180	-	6.7 %	6.7 %	6.7 %
>180	-	7.0 %	-	7.0 %
Total	7.2 %	7.5 %	6.5 %	7.0 %

*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: $((\text{Tasa Pactada}/\text{Tasa de Contado})^{\frac{360}{\text{Plazo}}}) - 1$. Para el cálculo de la devaluación implícita se excluyen las operaciones intragrupo.

Cuadro No. 3
Vencimientos de Forwards

Sectores	23 al 27 de mayo				30 de may. al 3 de junio				6 al 10 de junio			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	19	130	3922	4017	20	105	2816	2676	6	78	2638	2148
Intragruppo y off-shore***	0	0	1775	1111	0	0	1585	1062	0	0	1052	1026
Otros	129	19	1140	1709	105	20	475	1133	78	6	541	1058
Total	148	149	6837	6837	125	125	4876	4871	84	84	4232	4232

* 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.