

Fecha de Publicación: 26 de mayo de 2016

Fecha de Información: 24 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\$1291.9 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 5.9%.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	352.0	139.9	78.1	248.1	6.8	48.9	55.0
15-35	358.1	516.4	380.5	82.5	45.3	185.0	90.6
36-60	27.1	3.1	0.0	25.0	3.1	2.1	0.0
61-90	0.6	2.3	0.0	0.0	2.3	0.6	0.0
91-180	4.0	6.4	0.0	1.4	6.4	2.6	0.0
>180	16.9	25.7	0.0	0.0	10.6	1.9	15.0
Total	758.7	693.8	458.6	357.0	74.6	241.2	160.6

* 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	-0.2 %	7.6 %	1.8 %	2.7 %
15-35	7.5 %	7.6 %	7.4 %	7.5 %
36-60	-	7.8 %	7.6 %	7.7 %
61-90	-	8.1 %	6.6 %	7.8 %
91-180	-	7.6 %	6.9 %	7.3 %
>180	6.9 %	6.9 %	6.0 %	6.8 %
Total	4.8 %	7.6 %	4.8 %	5.9 %

* 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**	39	128	4163	4051	21	104	2905	2772	6	79	2676	2203
Intragrupo y off-shore***	0	0	1775	1317	0	0	1653	1104	0	0	1102	1026
Otros	128	39	1142	1713	104	21	479	1157	79	6	546	1095
Total	167	167	7080	7080	125	125	5037	5032	85	85	4324	4324

* 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.