

Fecha de Publicación: 27 de mayo de 2016

Fecha de Información: 25 de mayo de miércoles 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\$1254.7 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	194.2	145.0	77.4	121.0	16.6	22.2	51.0
15-35	310.9	425.8	327.5	106.6	12.8	118.8	85.5
36-60	67.0	2.2	0.0	65.0	2.2	2.0	0.0
61-90	3.1	8.3	0.9	0.0	7.4	3.1	0.0
91-180	70.5	97.0	0.1	0.0	96.9	70.5	0.0
>180	6.9	60.2	0.0	5.0	60.2	1.9	0.0
Total	652.7	738.5	405.8	297.6	196.2	218.6	136.5

* 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	7.9 %	7.0 %	7.1 %	7.2 %
15-35	5.2 %	8.1 %	7.6 %	7.4 %
36-60	-	7.8 %	6.4 %	6.5 %
61-90	-	7.7 %	7.1 %	7.5 %
91-180	-	6.8 %	6.7 %	6.8 %
>180	-	7.2 %	6.9 %	7.1 %
Total	6.2 %	7.5 %	7.2 %	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: $((\text{Tasa Pactada}/\text{Tasa de Contado})^{\wedge} (360/\text{Plazo})) - 1$. 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**	41	129	4281	4097	21	95	2950	2867	6	78	2707	2236
Intragrupo y off-shore***	0	0	1813	1425	0	0	1714	1117	0	0	1104	1026
Otros	128	41	1151	1723	95	21	492	1167	78	6	547	1097
Total	169	169	7244	7244	116	116	5156	5151	84	84	4359	4359

* 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.