Fecha de Publicación: 13 de mayo de 2016

Fecha de Información: 11 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$1508.1 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 6.9%.[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	434.3	160.2	104.0	356.0	39.2	61.3	17.0
15-35	332.5	556.8	374.4	164.1	89.1	75.1	93.3
36-60	20.9	34.3	0.0	0.0	14.3	0.9	20.0
61-90	14.0	6.2	0.0	10.0	6.2	4.0	0.0
91-180	16.9	33.2	20.1	0.0	13.1	16.9	0.0
>180	19.0	16.2	0.0	8.0	10.2	5.0	6.0
Total	**837.6**	**806.8**	**498.4**	**538.1**	**172.1**	**163.2**	**136.3**

* 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	7.0 %	7.4 %	6.1 %	6.5 %
15-35	6.9 %	7.5 %	6.7 %	7.2 %
36-60	7.0 %	7.0 %	5.9 %	7.0 %
61-90	-	6.9 %	6.5 %	6.6 %
91-180	-	6.4 %	6.6 %	6.5 %
>180	6.2 %	7.0 %	5.6 %	6.2 %
Total	6.9 %	7.4 %	6.3 %	6.9 %

*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: ((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	9 al 13 de mayo				16 al 20 de mayo				23 al 27 de mayo			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	18	118	3219	3158	26	135	3425	2875	12	123	2758	2944
Intragrupo y off-shore***	0	0	1517	1172	0	0	1395	940	0	0	1373	663
Otros	118	18	747	1153	135	26	824	1826	123	12	829	1353
Total	**136**	**136**	**5483**	**5483**	**161**	**161**	**5643**	**5640**	**135**	**135**	**4960**	**4960**

* 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.