Fecha de Publicación: 18 de mayo de 2016

Fecha de Información: 16 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$1215.5 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 6.6%.[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	210.5	227.2	133.6	79.5	43.6	81.0	50.0
15-35	377.1	319.8	239.3	141.9	10.5	165.2	70.0
36-60	19.5	43.3	0.0	0.0	43.3	19.5	0.0
61-90	23.7	3.1	0.0	0.0	3.1	23.7	0.0
91-180	35.8	36.1	0.0	0.0	36.1	35.8	0.0
>180	29.9	19.1	0.0	12.0	9.6	8.3	9.5
Total	**696.5**	**648.6**	**372.9**	**233.4**	**146.2**	**333.5**	**129.5**

* 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	6.8 %	7.4 %	6.9 %	7.1 %
15-35	4.8 %	6.3 %	6.9 %	6.4 %
36-60	-	7.0 %	6.5 %	6.8 %
61-90	-	7.3 %	6.6 %	6.7 %
91-180	-	6.7 %	6.4 %	6.5 %
>180	5.9 %	6.7 %	5.8 %	6.0 %
Total	5.7 %	6.8 %	6.8 %	6.6 %

*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**	26	135	3778	3485	14	128	3132	3291	17	105	2424	2202
Intragrupo y off-shore***	0	0	1810	1061	0	0	1489	746	0	0	1317	962
Otros	135	26	855	1895	128	14	980	1563	105	17	374	947
Total	**161**	**161**	**6444**	**6441**	**142**	**142**	**5601**	**5601**	**122**	**122**	**4116**	**4111**

* 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.