Fecha de Publicación: 20 de mayo de 2016

Fecha de Información: 18 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$1582.1 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 7.5%.[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	270.7	260.7	136.0	122.5	53.7	77.2	71.0
15-35	393.7	491.3	358.6	143.3	60.2	177.9	72.5
36-60	38.2	41.4	7.0	25.0	34.4	13.2	0.0
61-90	23.8	72.6	0.0	0.0	72.6	23.8	0.0
91-180	31.4	22.1	10.0	0.0	12.1	31.4	0.0
>180	67.2	22.6	0.0	0.0	12.6	57.2	10.0
Total	**824.9**	**910.7**	**511.6**	**290.8**	**245.5**	**380.7**	**153.5**

* 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	7.8 %	7.8 %	6.6 %	7.2 %
15-35	8.0 %	8.1 %	7.6 %	7.9 %
36-60	-	8.1 %	6.8 %	7.8 %
61-90	-	7.1 %	6.9 %	7.0 %
91-180	-	7.3 %	6.8 %	7.0 %
>180	6.2 %	6.8 %	6.2 %	6.3 %
Total	7.8 %	7.9 %	7.1 %	7.5 %

*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**	24	139	3951	3582	17	124	3378	3631	19	105	2585	2352
Intragrupo y off-shore***	0	0	1903	1226	0	0	1611	779	0	0	1385	994
Otros	139	24	859	1902	124	17	1071	1650	105	19	429	1048
Total	**163**	**163**	**6713**	**6710**	**141**	**141**	**6060**	**6060**	**125**	**125**	**4399**	**4394**

* 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.