

Fecha de Publicación: 3 de mayo de 2016

Fecha de Información: 29 de abril de viernes 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\$1519.8 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 5.3%.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	232.9	213.9	74.0	99.0	77.9	71.9	62.0
15-35	615.9	371.5	130.5	312.3	98.3	161.0	142.7
36-60	1.7	14.2	0.0	0.0	14.2	1.7	0.0
61-90	0.7	51.2	20.1	0.0	31.0	0.5	0.2
91-180	49.1	39.4	0.0	0.0	37.9	47.6	1.6
>180	90.4	54.2	35.1	25.0	10.0	56.2	9.1
Total	990.8	744.5	259.7	436.3	269.3	339.0	215.6

* 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 intragruppo		Total
	Compras/Ventas	Compras	Ventas	
3-14	7.1 %	5.6 %	2.2 %	4.5 %
15-35	4.4 %	6.3 %	5.4 %	5.4 %
36-60	-	6.6 %	5.6 %	6.4 %
61-90	6.1 %	6.0 %	5.5 %	6.0 %
91-180	6.2 %	6.5 %	5.6 %	6.0 %
>180	6.1 %	6.2 %	6.0 %	6.0 %
Total	5.3 %	6.1 %	4.8 %	5.3 %

*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 intragruppo.

Cuadro No. 3
Vencimientos de Forwards

Sectores	25 al 29 de abril				2 al 6 de mayo				9 al 13 de mayo			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	96	170	4282	3628	414	163	4101	4064	14	120	2485	2470
Intragrupo y off-shore***	0	0	1808	1496	0	221	2119	1289	0	0	1070	677
Otros	169	96	860	1825	163	193	609	1477	120	14	664	1072
Total	266	266	6950	6949	577	577	6829	6829	134	134	4219	4219

* 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.