

Fecha de Publicación: 6 de mayo de 2016

Fecha de Información: 04 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\$1920.3 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 5.0%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero**		Intragruo y Off-shore***		Otros Agentes		Interbancarios
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	538.3	187.9	114.5	390.0	16.4	91.3	57.0
15-35	419.7	613.2	521.3	169.0	24.9	183.7	67.0
36-60	112.6	28.8	0.0	40.5	28.8	72.1	0.0
61-90	11.5	15.5	0.0	0.0	15.5	11.5	0.0
91-180	38.5	44.5	0.0	0.0	44.5	38.5	0.0
>180	10.3	23.4	17.0	0.0	6.4	10.3	0.0
Total	1131.0	913.3	652.8	599.5	136.5	407.5	124.0

* 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 intragruo		Total
		Compras	Ventas	
3-14	6.7 %	6.8 %	2.0 %	3.3 %
15-35	6.6 %	5.2 %	6.3 %	5.7 %
36-60	-	6.7 %	6.2 %	6.3 %
61-90	-	6.6 %	6.1 %	6.4 %
91-180	-	6.4 %	6.1 %	6.3 %
>180	-	6.2 %	6.0 %	6.1 %
Total	6.7 %	5.6 %	4.3 %	5.0 %

*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: $((\text{Tasa Pactada}/\text{Tasa de Contado})^{\frac{1}{360/\text{Plazo}}}) - 1$. Para el cálculo de la devaluación implícita se excluyen las operaciones intragruo.

Cuadro No. 3
Vencimientos de Forwards

Sectores	2 al 6 de mayo				9 al 13 de mayo				16 al 20 de mayo			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	417	160	4590	4257	15	132	2720	2771	24	140	3167	2414
Intragrupo y off-shore***	0	221	2235	1678	0	0	1244	811	0	0	1104	834
Otros	160	196	621	1512	132	15	722	1104	140	24	745	1764
Total	576	576	7446	7446	147	147	4686	4686	164	164	5015	5012

* 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.