

Fecha de Publicación: 10 de mayo de 2016

Fecha de Información: 05 de mayo de jueves 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\$1758.1 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 6.7%.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	335.0	392.1	253.3	217.0	63.9	43.0	75.0
15-35	707.0	410.6	280.3	309.3	31.9	299.3	98.5
36-60	1.1	17.7	0.0	0.0	17.7	1.1	0.0
61-90	21.2	2.8	0.0	20.0	2.8	1.2	0.0
91-180	7.2	8.4	1.4	0.0	7.0	7.2	0.0
>180	14.0	14.4	0.0	0.0	14.4	14.0	0.0
Total	1085.5	846.1	534.9	546.3	137.7	365.8	173.5

* 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	6.5 %	6.6 %	6.5 %	6.6 %
15-35	6.5 %	6.7 %	6.8 %	6.8 %
36-60	-	6.9 %	5.7 %	6.8 %
61-90	-	7.0 %	6.8 %	6.8 %
91-180	-	6.8 %	6.0 %	6.4 %
>180	-	7.5 %	6.0 %	6.7 %
Total	6.5 %	6.7 %	6.7 %	6.7 %

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

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	153	4827	4354	16	132	2748	2970	24	140	3247	2570
Intragruppo y off-shore***	0	221	2286	1869	0	0	1414	811	0	0	1194	860
Otros	153	196	648	1538	132	16	730	1111	140	24	768	1776
Total	570	570	7761	7761	148	148	4892	4892	164	164	5209	5206

* 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.