

Fecha de Publicación: 11 de mayo de 2016

Fecha de Información: 06 de mayo 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\$1022.0 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 6.4%.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	114.0	121.4	66.5	48.1	29.9	40.9	25.0
15-35	336.7	312.0	231.1	101.8	10.3	164.4	70.6
36-60	5.4	7.9	0.0	0.0	7.9	5.4	0.0
61-90	1.8	47.9	35.0	0.0	12.9	1.8	0.0
91-180	73.5	13.7	0.1	65.0	13.5	8.5	0.0
>180	33.8	49.6	36.0	25.0	13.6	8.8	0.0
Total	565.2	552.4	368.7	239.9	88.0	229.8	95.6

* 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 intragrupo		Total
	Compras/Ventas	Compras	Ventas	
3-14	5.5 %	6.1 %	5.3 %	5.7 %
15-35	6.4 %	6.9 %	6.5 %	6.7 %
36-60	-	7.5 %	6.1 %	6.9 %
61-90	-	6.9 %	6.0 %	6.9 %
91-180	-	6.7 %	6.5 %	6.6 %
>180	-	6.3 %	6.0 %	6.2 %
Total	6.2 %	6.7 %	6.3 %	6.4 %

* 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: $((\text{Tasa Pactada} / \text{Tasa de Contado}) ^ {360 / \text{Plazo}}) - 1$. 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	148	4827	4355	17	125	2833	3034	25	141	3269	2620
Intragruppo y off-shore***	0	221	2286	1869	0	0	1450	854	0	0	1225	865
Otros	148	196	648	1538	125	17	738	1133	141	25	783	1788
Total	565	565	7761	7761	142	142	5021	5021	166	166	5277	5274

* 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.