

Fecha de Publicación: 8 de abril de 2016

Fecha de Información: 06 de abril 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\$1953.6 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 6.9%.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	620.0	366.5	177.1	392.0	21.5	60.0	168.0
15-35	723.1	498.2	287.8	256.6	6.0	262.0	204.5
36-60	2.2	21.4	0.0	0.5	21.4	1.7	0.0
61-90	17.0	3.7	0.0	0.0	3.7	17.0	0.0
91-180	11.7	45.2	30.5	0.0	14.7	11.7	0.0
>180	0.3	16.7	10.5	0.0	6.2	0.3	0.0
Total	1374.3	951.8	505.8	649.1	73.5	352.7	372.5

* 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	2.6 %	4.3 %	15.0 %	9.9 %
15-35	4.4 %	5.7 %	4.6 %	4.9 %
36-60	-	5.1 %	4.3 %	5.0 %
61-90	-	5.7 %	5.0 %	5.1 %
91-180	-	5.6 %	5.3 %	5.5 %
>180	-	6.2 %	5.5 %	6.2 %
Total	3.6 %	5.3 %	9.2 %	6.9 %

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

Cuadro No. 3
Vencimientos de Forwards

Sectores	4 al 8 de abril				11 al 15 de abril				18 al 22 de abril			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	28	105	4174	3264	32	110	3339	2983	13	106	2339	1765
Intragruppo y off-shore***	0	0	1623	1811	0	0	1300	774	0	0	512	629
Otros	105	28	634	1356	110	32	839	1722	106	13	686	1143
Total	133	133	6431	6431	142	142	5479	5479	119	119	3537	3537

* 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.