

Fecha de Publicación: 11 de abril de 2016

Fecha de Información: 07 de abril 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\$1840.1 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 4.8%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero**		Intragrupa y Off-shore***		Otros Agentes		Interbancarios
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	402.4	341.4	51.0	135.8	99.4	75.6	191.0
15-35	505.4	593.5	385.8	156.5	56.2	197.4	151.5
36-60	6.4	17.3	0.0	0.0	17.3	6.4	0.0
61-90	71.2	32.5	20.0	65.0	12.5	6.2	0.0
91-180	82.2	101.4	9.5	60.0	72.0	2.2	20.0
>180	36.0	47.2	10.0	0.0	2.7	1.5	34.5
Total	1103.7	1133.4	476.3	417.3	260.1	289.4	397.0

* 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 intragrupo		Total
	Compras/Ventas	Compras	Ventas	
3-14	4.4 %	4.9 %	4.0 %	4.4 %
15-35	4.9 %	4.7 %	4.6 %	4.7 %
36-60	-	5.1 %	4.6 %	5.0 %
61-90	-	5.7 %	5.3 %	5.3 %
91-180	5.8 %	6.0 %	5.6 %	5.8 %
>180	6.0 %	6.0 %	5.2 %	6.0 %
Total	4.8 %	4.9 %	4.6 %	4.8 %

* 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	106	4256	3319	33	111	3619	3233	13	106	2438	1813
Intragruppo y off-shore***	0	0	1643	1853	0	0	1331	868	0	0	525	629
Otros	106	28	635	1361	111	33	921	1770	106	13	702	1223
Total	134	134	6533	6533	143	143	5871	5871	119	119	3665	3665

* 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.