

Fecha de Publicación: 13 de abril de 2016

Fecha de Información: 11 de abril de lunes 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\$1263.5 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 4.6%.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	282.1	299.7	78.2	112.4	93.5	41.8	128.0
15-35	386.0	219.7	138.8	152.3	27.4	180.3	53.5
36-60	0.8	55.4	0.1	0.0	55.4	0.8	0.0
61-90	6.5	20.0	0.0	0.0	20.0	6.5	0.0
91-180	91.9	37.7	0.0	20.5	37.7	71.5	0.0
>180	22.6	42.6	5.0	0.0	17.6	2.6	20.0
Total	789.9	675.1	222.1	285.1	251.5	303.4	201.5

* 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 intragruppo		Total
	Compras/Ventas	Compras	Ventas	
3-14	4.6 %	4.9 %	3.6 %	4.4 %
15-35	3.7 %	4.6 %	4.1 %	4.2 %
36-60	-	5.4 %	4.5 %	5.4 %
61-90	-	5.7 %	4.9 %	5.5 %
91-180	-	6.1 %	5.1 %	5.4 %
>180	5.9 %	6.1 %	5.4 %	6.0 %
Total	4.5 %	5.1 %	4.2 %	4.6 %

*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 intragruppo.

Cuadro No. 3
Vencimientos de Forwards

Sectores	11 al 15 de abril				18 al 22 de abril				25 al 29 de abril			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	33	114	3970	3648	13	111	2546	1904	51	164	2656	2020
Intragrupa y off-shore***	0	0	1592	1049	0	0	546	714	0	0	864	833
Otros	114	33	932	1796	111	13	761	1236	164	51	602	1269
Total	147	147	6493	6493	124	124	3853	3853	215	215	4122	4122

* 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.