

Fecha de Publicación: 14 de abril de 2016

Fecha de Información: 12 de abril de martes 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\$1431.7 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 4.6%.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	262.7	239.1	83.0	56.3	37.1	87.4	119.0
15-35	490.0	452.7	204.0	239.5	58.2	60.0	190.5
36-60	6.6	21.6	0.1	0.0	21.5	6.6	0.0
61-90	7.1	8.2	0.0	0.1	8.2	7.0	0.0
91-180	0.1	91.3	0.0	0.0	91.3	0.1	0.0
>180	115.4	56.4	20.0	105.0	26.4	0.4	10.0
Total	881.9	869.4	307.1	400.9	242.8	161.5	319.5

* 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	5.0 %	1.8 %	3.5 %	3.4 %
15-35	4.6 %	5.0 %	4.1 %	4.6 %
36-60	-	4.9 %	4.9 %	4.9 %
61-90	-	5.9 %	5.1 %	5.5 %
91-180	-	6.2 %	5.3 %	6.2 %
>180	6.0 %	6.2 %	6.1 %	6.1 %
Total	4.8 %	4.6 %	4.4 %	4.6 %

*Incluye solo operaciones interbancarias

En el cuadro No. 3 se presentan los vencimientos de forwards para ésta y las próximas dos semanas.

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**	34	115	4047	3759	13	112	2642	2010	51	164	2805	2075
Intragrupa y off-shore***	0	0	1647	1059	0	0	569	740	0	0	877	877
Otros	115	34	936	1811	111	13	793	1254	164	51	614	1345
Total	149	149	6629	6629	125	125	4004	4004	216	216	4296	4296

* 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.

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.