

Fecha de Publicación: 19 de abril de 2016

Fecha de Información: 15 de abril 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\$1265.1 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 4.4%.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	177.6	312.1	136.5	18.8	122.9	106.1	52.8
15-35	386.2	305.2	167.6	125.1	78.6	202.1	59.0
36-60	3.3	6.2	0.0	0.0	6.2	3.3	0.0
61-90	22.8	56.8	0.0	0.0	46.8	12.8	10.0
91-180	13.3	42.0	0.1	0.0	41.9	13.3	0.0
>180	49.2	17.2	0.0	15.0	12.2	29.2	5.0
Total	652.4	739.4	304.2	158.9	308.5	366.7	126.8

* 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 %	5.3 %	-4.1 %	2.1 %
15-35	4.9 %	5.7 %	4.9 %	5.2 %
36-60	-	6.0 %	5.0 %	5.7 %
61-90	5.4 %	6.0 %	5.4 %	5.8 %
91-180	-	6.3 %	5.7 %	6.2 %
>180	6.1 %	6.5 %	6.0 %	6.1 %
Total	4.8 %	5.6 %	3.0 %	4.4 %

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

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**	35	113	4222	3823	31	125	2902	2447	52	166	3148	2423
Intragruppo y off-shore***	0	0	1658	1159	10	0	812	784	0	0	981	918
Otros	113	35	930	1830	115	31	844	1327	166	52	756	1545
Total	148	148	6811	6811	156	156	4558	4558	218	218	4886	4886

* 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.