

Fecha de Publicación: 20 de abril de 2016

Fecha de Información: 18 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\$1620.2 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 5.4%.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	325.9	346.4	140.0	96.0	65.4	88.9	141.0
15-35	415.5	316.3	177.8	72.0	31.1	236.0	107.5
36-60	83.3	37.0	0.0	46.0	37.0	37.3	0.0
61-90	7.2	86.8	46.0	4.5	40.8	2.7	0.0
91-180	97.5	56.8	3.4	20.0	53.4	77.5	0.0
>180	42.2	64.6	0.0	17.0	53.6	14.2	11.0
Total	971.7	908.0	367.2	255.5	281.3	456.7	259.5

* 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	4.9 %	5.5 %	4.0 %	4.7 %
15-35	5.5 %	6.5 %	4.7 %	5.4 %
36-60	-	6.3 %	5.3 %	5.6 %
61-90	-	5.9 %	5.6 %	5.9 %
91-180	-	6.9 %	5.6 %	6.1 %
>180	6.1 %	6.4 %	6.0 %	6.2 %
Total	-	6.1 %	4.8 %	5.4 %

*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	18 al 22 de abril				25 al 29 de abril				2 al 6 de mayo			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	31	121	3006	2561	52	181	3306	2604	280	162	2896	3010
Intragruppo y off-shore***	10	0	880	839	0	0	1052	945	0	143	1670	957
Otros	111	31	849	1335	180	52	802	1612	162	138	507	1106
Total	152	152	4735	4735	232	232	5161	5161	442	442	5072	5072

* 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.