

Fecha de Publicación: 21 de abril de 2016

Fecha de Información: 19 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\$1965.9 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 5.3%.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	380.5	453.6	248.7	131.4	19.9	64.1	185.0
15-35	640.5	384.5	203.5	307.5	64.0	216.0	117.0
36-60	47.0	79.5	20.5	45.0	59.0	2.0	0.0
61-90	45.7	50.3	17.2	40.0	33.1	5.7	0.0
91-180	32.0	68.3	0.0	0.0	68.3	32.0	0.0
>180	33.2	62.8	0.0	10.3	52.8	12.9	10.0
Total	1178.9	1099.0	490.0	534.2	297.0	332.7	312.0

* 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	5.4 %	5.2 %	4.0 %	4.9 %
15-35	5.5 %	5.2 %	5.1 %	5.2 %
36-60	-	5.9 %	5.5 %	5.8 %
61-90	-	6.4 %	5.3 %	6.2 %
91-180	-	6.2 %	5.7 %	6.0 %
>180	6.2 %	6.4 %	5.5 %	6.2 %
Total	5.5 %	5.6 %	4.9 %	5.3 %

* 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	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**	29	113	3161	2706	52	182	3463	2855	296	165	3008	3090
Intragrupa y off-shore***	10	0	945	907	0	0	1235	1001	0	153	1672	978
Otros	103	29	856	1350	182	52	817	1659	164	143	509	1121
Total	142	142	4962	4962	233	233	5514	5514	460	460	5189	5189

* 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.