

Fecha de Publicación: 25 de abril de 2016

Fecha de Información: 21 de abril de jueves 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\$1719.0 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 5.4%.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	209.3	318.7	233.0	30.5	16.7	109.8	69.0
15-35	461.3	669.9	376.5	78.0	86.9	176.8	206.5
36-60	85.9	32.9	0.0	85.0	32.9	0.9	0.0
61-90	8.8	16.4	0.0	0.0	11.4	3.8	5.0
91-180	108.5	89.7	0.1	80.0	74.6	13.5	15.0
>180	6.4	6.8	0.0	3.2	6.8	3.2	0.0
Total	880.2	1134.4	609.6	276.7	229.3	308.0	295.5

* 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	5.4 %	5.9 %	4.3 %	5.3 %
15-35	5.1 %	5.4 %	5.0 %	5.2 %
36-60	-	5.9 %	5.7 %	5.8 %
61-90	5.7 %	6.5 %	5.7 %	6.2 %
91-180	6.0 %	6.4 %	5.9 %	6.1 %
>180	-	6.4 %	5.0 %	6.0 %
Total	5.2 %	5.7 %	5.1 %	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: $((Tasa\ Pactada/Tasa\ de\ Contado) \wedge (360/Plazo)) - 1$. 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**	28	114	3244	2784	52	184	3533	3132	345	167	3358	3219
Intragrupa y off-shore***	10	0	1001	934	0	0	1493	1025	0	170	1697	1004
Otros	104	28	874	1402	183	52	836	1705	166	175	519	1351
Total	142	142	5120	5120	236	236	5863	5863	512	512	5574	5574

* 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.