

Fecha de Publicación: 26 de abril de 2016

Fecha de Información: 22 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\$1368.4 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 4.8%.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	252.6	357.7	219.0	51.0	21.2	84.1	117.5
15-35	492.0	256.1	149.6	82.5	25.5	328.5	81.0
36-60	5.6	3.9	0.0	0.0	3.9	5.6	0.0
61-90	11.6	16.6	0.0	0.0	16.6	11.6	0.0
91-180	12.5	30.5	0.0	0.0	29.3	11.3	1.2
>180	105.4	24.8	0.0	95.0	23.6	9.2	1.2
Total	879.7	689.6	368.6	228.5	120.1	450.3	200.9

* 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	5.5 %	5.9 %	-1.2 %	3.7 %
15-35	4.7 %	5.6 %	5.2 %	5.2 %
36-60	-	6.1 %	5.4 %	5.7 %
61-90	-	6.1 %	5.8 %	6.0 %
91-180	6.0 %	6.4 %	5.8 %	6.2 %
>180	6.1 %	6.4 %	6.1 %	6.1 %
Total	5.2 %	5.8 %	4.1 %	4.8 %

*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**	27	114	3244	2785	96	179	3648	3314	345	167	3453	3394
Intragrupa y off-shore***	10	0	1001	934	0	0	1616	1065	0	170	1793	1015
Otros	104	27	876	1401	179	96	855	1740	167	175	520	1357
Total	141	141	5121	5121	276	276	6119	6119	512	512	5766	5766

* 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.