

Fecha de Publicación: 28 de abril de 2016

Fecha de Información: 26 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\$1119.0 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 5.8%.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	180.7	120.4	36.5	70.0	13.9	40.7	70.0
15-35	492.3	317.6	197.8	128.5	20.8	264.8	99.0
36-60	11.2	27.6	0.0	9.0	27.6	2.2	0.0
61-90	14.7	24.0	0.0	0.0	24.0	14.7	0.0
91-180	47.4	15.5	0.0	40.0	15.5	7.4	0.0
>180	21.5	15.1	0.0	20.0	15.1	1.5	0.0
Total	767.8	520.2	234.3	267.5	117.0	331.3	169.0

* 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	6.0 %	6.2 %	4.8 %	5.5 %
15-35	6.0 %	5.7 %	5.8 %	5.8 %
36-60	-	6.1 %	5.8 %	6.0 %
61-90	-	6.6 %	5.9 %	6.3 %
91-180	-	6.5 %	6.0 %	6.1 %
>180	-	6.7 %	6.0 %	6.3 %
Total	6.0 %	6.0 %	5.6 %	5.8 %

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

Cuadro No. 3
Vencimientos de Forwards

Sectores	25 al 29 de abril				2 al 6 de mayo				9 al 13 de mayo			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	96	174	3864	3540	405	170	3648	3627	10	114	2354	2244
Intragruppo y off-shore***	0	0	1772	1197	0	221	1880	1049	0	0	985	676
Otros	174	96	860	1760	169	184	546	1398	114	10	611	1029
Total	271	271	6496	6496	575	575	6074	6074	124	124	3950	3950

* 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.