

Fecha de Publicación: 29 de abril de 2016

Fecha de Información: 27 de abril de miércoles 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\$1920.5 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	395.1	273.5	166.9	280.4	23.2	31.3	83.4
15-35	604.4	584.6	369.2	141.3	30.5	278.2	185.0
36-60	76.5	23.8	0.0	0.0	23.8	76.5	0.0
61-90	32.0	6.3	0.0	0.0	6.3	32.0	0.0
91-180	115.8	43.5	0.0	40.0	43.5	75.8	0.0
>180	20.0	23.3	10.0	10.0	3.3	0.0	10.0
Total	1243.8	955.1	546.1	471.7	130.6	493.8	278.4

* 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	5.7 %	6.3 %	3.1 %	4.6 %
15-35	4.2 %	6.1 %	5.9 %	5.6 %
36-60	-	6.5 %	5.7 %	5.9 %
61-90	-	6.7 %	5.8 %	6.0 %
91-180	-	6.3 %	6.0 %	6.1 %
>180	6.1 %	6.2 %	6.2 %	6.2 %
Total	4.7 %	6.2 %	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	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**	97	175	4188	3597	407	170	3764	3830	14	115	2371	2278
Intragrupa y off-shore***	0	0	1798	1426	0	221	2021	1100	0	0	1005	677
Otros	175	97	858	1821	170	186	557	1413	115	14	625	1045
Total	271	271	6844	6843	577	577	6343	6343	129	129	4001	4001

* 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.