

Fecha de Publicación: 2 de mayo de 2016

Fecha de Información: 28 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\$1353.8 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 5.9%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero**		Intragrupa y Off-shore***		Otros Agentes		Interbancarios
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	299.9	225.4	98.8	159.8	17.6	31.1	109.0
15-35	457.3	358.9	106.3	116.0	132.8	221.5	119.8
36-60	2.2	20.4	0.0	0.0	20.4	2.2	0.0
61-90	6.3	22.6	0.8	0.0	21.8	6.3	0.0
91-180	28.9	75.4	5.2	0.0	70.2	28.9	0.0
>180	45.5	79.8	30.0	0.0	9.8	5.5	40.0
Total	840.1	782.5	241.1	275.8	272.6	295.5	268.8

* 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	5.8 %	6.1 %	5.7 %	5.9 %
15-35	5.9 %	5.7 %	5.8 %	5.8 %
36-60	-	6.7 %	5.0 %	6.6 %
61-90	-	6.5 %	5.7 %	6.3 %
91-180	-	6.2 %	5.8 %	6.1 %
>180	6.1 %	6.3 %	5.8 %	6.2 %
Total	-	6.0 %	5.8 %	5.9 %

*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**	96	172	4282	3631	408	170	3894	3898	14	119	2466	2420
Intragruppo y off-shore***	0	0	1808	1496	0	221	2056	1190	0	0	1059	677
Otros	172	96	862	1825	170	187	558	1421	119	14	636	1064
Total	269	269	6952	6951	578	578	6508	6508	134	134	4161	4161

* 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.