

Fecha de Publicación: 28 de marzo de 2016

Fecha de Información: 22 de marzo 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\$823.2 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 4.9%.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	146.8	253.1	162.8	74.6	44.3	26.1	46.0
15-35	161.2	152.8	111.0	116.5	15.8	18.7	26.0
36-60	39.4	10.7	0.0	0.0	10.7	39.4	0.0
61-90	26.0	10.4	0.0	0.0	10.4	26.0	0.0
91-180	6.3	53.6	16.2	1.6	37.5	4.7	0.0
>180	11.2	23.5	0.0	10.7	23.5	0.5	0.0
Total	391.0	504.2	290.0	203.4	142.2	115.6	72.0

* 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	4.8 %	5.1 %	4.0 %	4.6 %
15-35	4.9 %	5.0 %	4.6 %	4.8 %
36-60	-	5.5 %	4.6 %	4.8 %
61-90	-	5.9 %	4.6 %	5.0 %
91-180	-	6.1 %	5.4 %	6.0 %
>180	-	6.1 %	5.2 %	6.0 %
Total	4.8 %	5.3 %	4.4 %	4.9 %

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

Cuadro No. 3
Vencimientos de Forwards

Sectores	21 al 25 de marzo				28 de mar. al 1 de abril				4 al 8 de abril			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	1	84	1391	1522	51	218	4271	3649	20	94	3062	2674
Intragruppo y off-shore***	0	0	776	620	0	0	1692	1412	0	0	1346	1143
Otros	84	1	240	264	218	51	954	1856	94	20	527	1119
Total	85	85	2406	2406	269	269	6917	6917	115	115	4935	4935

* 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.