

Fecha de Publicación: 29 de marzo de 2016

Fecha de Información: 23 de marzo 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\$571.0 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	85.8	153.4	99.0	4.0	27.4	54.8	27.0
15-35	191.7	145.3	102.0	87.8	8.4	68.9	35.0
36-60	4.7	7.2	0.0	0.0	7.2	4.7	0.0
61-90	1.6	4.9	0.0	0.0	4.9	1.6	0.0
91-180	10.2	17.3	0.0	10.0	17.3	0.2	0.0
>180	1.0	9.9	2.0	0.0	8.0	1.0	0.0
Total	295.0	338.0	202.9	101.8	73.1	131.3	62.0

* 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	4.9 %	9.0 %	3.9 %	7.0 %
15-35	7.0 %	4.3 %	4.8 %	4.9 %
36-60	-	5.0 %	4.3 %	4.8 %
61-90	-	5.9 %	4.6 %	5.5 %
91-180	-	6.1 %	4.5 %	6.1 %
>180	-	6.0 %	5.5 %	6.0 %
Total	6.1 %	6.9 %	4.5 %	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	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	82	1402	1527	52	231	4341	3772	20	95	3081	2694
Intragruppo y off-shore***	0	0	776	620	0	0	1786	1416	0	0	1356	1143
Otros	82	1	244	275	231	52	962	1900	95	20	528	1128
Total	83	83	2422	2422	284	284	7088	7088	115	115	4964	4964

* 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.