

Fecha de Publicación: 30 de marzo de 2016

Fecha de Información: 28 de marzo de lunes 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\$927.0 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 4.2%.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	210.6	165.4	80.0	91.0	37.3	71.5	48.1
15-35	243.6	227.4	96.5	110.8	37.8	39.7	93.1
36-60	5.9	42.4	0.0	0.0	42.4	5.9	0.0
61-90	0.1	8.8	0.1	0.0	8.7	0.1	0.0
91-180	60.8	88.2	0.0	0.0	88.2	60.8	0.0
>180	0.5	14.6	0.0	0.2	14.6	0.4	0.0
Total	521.6	546.7	176.6	201.9	228.9	178.5	141.2

* 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	-6.4 %	5.2 %	4.2 %	2.9 %
15-35	4.5 %	4.7 %	4.3 %	4.5 %
36-60	-	5.1 %	4.5 %	5.1 %
61-90	-	5.9 %	4.7 %	5.9 %
91-180	-	5.9 %	5.7 %	5.8 %
>180	-	6.1 %	5.3 %	6.1 %
Total	0.8 %	5.3 %	4.5 %	4.2 %

*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	28 de mar. al 1 de abril				4 al 8 de abril				11 al 15 de abril			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	52	230	4426	3911	20	100	3194	2713	21	111	2285	2256
Intragruppo y off-shore***	0	0	1866	1452	0	0	1356	1198	0	0	978	561
Otros	229	52	972	1901	100	20	547	1186	111	21	696	1142
Total	282	282	7264	7264	121	121	5097	5097	132	132	3959	3959

* 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.