

Fecha de Publicación: 31 de marzo de 2016

Fecha de Información: 29 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\$1532.7 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 4.7%.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	632.7	148.6	23.1	270.9	18.1	254.3	107.5
15-35	468.1	319.7	212.1	192.0	27.2	195.6	80.5
36-60	3.1	28.7	11.3	0.0	17.4	3.1	0.0
61-90	3.4	15.7	0.0	0.0	15.6	3.4	0.0
91-180	9.2	31.7	10.0	0.0	21.7	9.2	0.0
>180	32.8	51.9	10.0	0.0	16.9	7.8	25.0
Total	1149.3	596.4	266.4	462.9	117.0	473.4	213.0

* 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	3.8 %	5.7 %	4.0 %	4.1 %
15-35	5.9 %	5.5 %	4.8 %	5.1 %
36-60	-	5.5 %	4.8 %	5.4 %
61-90	-	5.4 %	4.7 %	5.3 %
91-180	-	5.8 %	5.3 %	5.7 %
>180	5.8 %	6.0 %	5.4 %	5.8 %
Total	4.8 %	5.6 %	4.4 %	4.7 %

*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	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	229	4609	3967	25	100	3398	2763	26	112	2593	2333
Intragrupa y off-shore***	0	0	1889	1598	0	0	1356	1281	0	0	1005	603
Otros	229	52	974	1906	100	25	561	1271	112	26	696	1358
Total	281	281	7472	7472	125	125	5315	5315	138	138	4294	4294

* 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.