

Fecha de Publicación: 1 de abril de 2016

Fecha de Información: 30 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\$1457.9 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 4.0%.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	373.9	60.8	22.0	246.0	33.3	122.4	5.5
15-35	295.5	383.0	197.0	183.1	152.5	78.9	33.5
36-60	70.4	62.3	17.2	13.6	20.1	31.8	25.0
61-90	10.9	102.7	0.0	0.0	102.7	10.9	0.0
91-180	15.3	74.9	10.0	0.0	57.9	8.3	7.0
>180	36.1	53.0	20.0	25.0	23.0	1.1	10.0
Total	802.2	736.7	266.2	467.7	389.5	253.5	81.0

* 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 intragruppo		Total
	Compras/Ventas	Compras	Ventas	
3-14	4.6 %	5.7 %	2.8 %	3.1 %
15-35	3.3 %	4.3 %	3.2 %	3.9 %
36-60	4.2 %	5.6 %	4.3 %	4.5 %
61-90	-	5.5 %	4.0 %	5.4 %
91-180	5.5 %	5.7 %	4.7 %	5.6 %
>180	5.7 %	5.9 %	5.3 %	5.7 %
Total	4.1 %	4.9 %	3.2 %	4.0 %

*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 intragruppo.

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**	58	219	4766	4001	25	100	3490	2795	26	113	2757	2349
Intragruppo y off-shore***	0	0	1909	1758	0	0	1358	1357	0	0	1005	626
Otros	219	58	989	1903	100	25	585	1282	113	26	712	1499
Total	277	277	7663	7663	126	126	5433	5433	139	139	4473	4473

* 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.