

Fecha de Publicación: 5 de abril de 2016

Fecha de Información: 01 de abril de viernes 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\$1018.4 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 3.2%.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	241.7	310.3	178.0	78.0	28.3	59.7	104.0
15-35	270.5	222.9	74.5	122.9	115.4	114.6	33.0
36-60	8.2	17.7	0.0	0.0	12.7	3.2	5.0
61-90	34.9	8.4	0.0	20.0	8.4	14.9	0.0
91-180	14.1	17.5	0.0	0.0	17.5	14.1	0.0
>180	10.0	4.2	0.0	10.0	4.2	0.0	0.0
Total	579.4	581.0	252.5	230.9	186.5	206.5	142.0

* 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	2.6 %	3.5 %	2.1 %	2.8 %
15-35	3.6 %	3.5 %	2.8 %	3.2 %
36-60	3.9 %	5.9 %	3.5 %	5.0 %
61-90	-	5.0 %	4.7 %	4.7 %
91-180	-	5.4 %	4.6 %	5.0 %
>180	-	5.9 %	5.4 %	5.6 %
Total	2.8 %	3.8 %	2.9 %	3.2 %

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

Cuadro No. 3
Vencimientos de Forwards

Sectores	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	203	4807	4043	27	106	3721	2969	31	114	2962	2595
Intragruppo y off-shore***	0	0	1949	1790	0	0	1441	1477	0	0	1099	684
Otros	203	58	990	1913	106	27	621	1337	114	31	783	1565
Total	261	261	7746	7746	132	132	5783	5783	145	145	4844	4844

* 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.