

Fecha de Publicación: 6 de abril de 2016

Fecha de Información: 04 de abril 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\$1025.5 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	264.7	138.3	61.0	39.5	23.3	171.2	54.0
15-35	228.4	157.8	101.8	75.0	48.1	145.4	8.0
36-60	6.4	54.8	0.0	0.0	49.8	1.4	5.0
61-90	10.8	13.8	0.0	0.0	13.8	10.8	0.0
91-180	72.9	96.5	0.0	0.0	96.5	72.9	0.0
>180	7.1	40.9	27.6	0.0	13.3	7.1	0.0
Total	590.3	502.2	190.3	114.5	244.8	408.8	67.0

* 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	3.7 %	3.9 %	3.3 %	3.5 %
15-35	4.1 %	4.8 %	2.5 %	3.5 %
36-60	3.5 %	4.3 %	3.3 %	4.2 %
61-90	-	7.7 %	4.5 %	6.3 %
91-180	-	5.7 %	5.5 %	5.6 %
>180	-	4.3 %	5.6 %	4.7 %
Total	3.8 %	4.9 %	3.4 %	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: $((Tasa\ Pactada/Tasa\ de\ Contado)^\wedge (360/Plazo)) - 1$. Para el cálculo de la devaluación implícita se excluyen las operaciones intragrupo.

Cuadro No. 3
Vencimientos de Forwards

Sectores	4 al 8 de abril				11 al 15 de abril				18 al 22 de abril			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	28	107	3781	3001	32	114	3100	2669	13	105	2073	1620
Intragruppo y off-shore***	0	0	1450	1505	0	0	1151	692	0	0	474	580
Otros	107	28	628	1353	114	32	783	1673	105	13	676	1023
Total	134	134	5859	5859	146	146	5034	5034	118	118	3223	3223

* 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.