Fecha de Publicación: 7 de abril de 2016

Fecha de Información: 05 de abril 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$1436.7 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 4.5%.[2]

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero**		Intragrupo y Off-shore***		Otros Agentes		Interbancarios
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	229.0	326.7	176.0	41.9	44.2	80.6	106.5
15-35	472.2	464.3	221.3	117.0	55.5	167.7	187.5
36-60	59.9	21.7	0.0	53.0	21.7	6.8	0.0
61-90	0.7	18.7	0.0	0.0	18.7	0.7	0.0
91-180	95.7	29.1	0.0	0.0	14.1	80.7	15.0
>180	10.9	16.8	0.1	0.0	16.7	10.9	0.0
Total	**868.5**	**877.3**	**397.4**	**211.9**	**170.9**	**347.5**	**309.0**

* 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 %	5.7 %	3.6 %	4.1 %
15-35	4.4 %	5.0 %	4.1 %	4.5 %
36-60	5.0 %	4.9 %	5.3 %	5.2 %
61-90	-	5.2 %	4.7 %	5.2 %
91-180	5.5 %	6.1 %	4.3 %	4.7 %
>180	-	6.0 %	5.3 %	5.7 %
Total	3.8 %	5.3 %	4.2 %	4.5 %

*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	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	3841	3146	32	114	3179	2824	13	106	2172	1653
Intragrupo y off-shore***	0	0	1558	1535	0	0	1214	697	0	0	479	590
Otros	107	28	634	1351	114	32	819	1692	106	13	679	1087
Total	**135**	**135**	**6033**	**6033**	**146**	**146**	**5213**	**5213**	**119**	**119**	**3330**	**3330**

* 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.