

**Fecha de Publicación: 1 de abril de 2016**

**Fecha de Información: 31 de marzo de jueves <sup>1</sup>**

**INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS**

Según el reporte de los Intermediarios del Mercado Cambiario durante el día se pactó un total de US\$1832.0 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 2.5%.<sup>2</sup>

**Cuadro No. 1**  
**Contratos Forwards Pactados**

Rango	Sector Financiero**		Intragrupa y Off-shore***		Otros Agentes		Interbancarios
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	206.8	148.6	40.0	132.0	77.6	43.8	31.0
15-35	455.9	595.3	389.5	127.3	82.2	205.1	123.6
36-60	4.0	9.6	0.0	0.0	9.6	4.0	0.0
61-90	70.9	41.5	0.0	15.0	36.5	50.9	5.0
91-180	229.3	109.6	0.0	140.0	76.6	56.3	33.0
>180	133.8	39.3	0.0	113.0	19.3	0.8	20.0
<b>Total</b>	<b>1100.8</b>	<b>943.8</b>	<b>429.5</b>	<b>527.3</b>	<b>301.7</b>	<b>360.9</b>	<b>212.6</b>

\* 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	-1.0 %	3.5 %	-0.1 %	0.9 %
15-35	1.3 %	1.8 %	1.5 %	1.6 %
36-60	-	4.3 %	2.1 %	3.7 %
61-90	3.6 %	4.6 %	3.7 %	4.0 %
91-180	4.7 %	5.4 %	4.8 %	5.0 %
>180	5.4 %	5.9 %	5.4 %	5.5 %
<b>Total</b>	<b>1.9 %</b>	<b>2.9 %</b>	<b>2.3 %</b>	<b>2.5 %</b>

\*Incluye solo operaciones interbancarias

En el cuadro No. 3 se presentan los vencimientos de forwards para ésta y las próximas dos semanas.

<sup>1</sup> Datos provisionales.

<sup>2</sup> 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
<b>Sector Financiero**</b>	58	206	4800	4043	26	101	3591	2847	26	114	2862	2412
<b>Intragruppo y off-shore***</b>	0	0	1949	1790	0	0	1358	1403	0	0	1005	680
<b>Otros</b>	206	58	990	1906	101	26	606	1305	114	26	775	1550
<b>Total</b>	<b>264</b>	<b>264</b>	<b>7738</b>	<b>7738</b>	<b>128</b>	<b>128</b>	<b>5555</b>	<b>5555</b>	<b>139</b>	<b>139</b>	<b>4642</b>	<b>4642</b>

\* 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.