

Fecha de Publicación: 12 de abril de 2016

Fecha de Información: 08 de abril de viernes <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\$1226.2 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 3.7%.<sup>2</sup>

Cuadro No. 1  
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero**		Intragruppo y Off-shore***		Otros Agentes		Interbancarios
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	244.7	262.4	203.3	158.6	9.2	36.1	50.0
15-35	363.5	285.1	164.8	126.3	45.4	162.3	75.0
36-60	6.3	9.6	6.2	0.0	3.5	6.3	0.0
61-90	1.2	7.5	0.0	0.0	7.5	1.2	0.0
91-180	85.9	75.5	1.7	20.0	72.9	65.1	0.9
>180	4.1	6.2	0.0	0.0	6.2	4.1	0.0
<b>Total</b>	<b>705.7</b>	<b>646.3</b>	<b>375.9</b>	<b>304.9</b>	<b>144.6</b>	<b>275.0</b>	<b>125.9</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	4.5 %	0.3 %	1.0 %	1.4 %
15-35	4.4 %	5.0 %	4.1 %	4.5 %
36-60	-	5.6 %	4.7 %	5.0 %
61-90	-	6.0 %	4.8 %	5.8 %
91-180	5.7 %	5.8 %	5.6 %	5.7 %
>180	-	6.2 %	5.2 %	5.8 %
<b>Total</b>	<b>4.4 %</b>	<b>4.0 %</b>	<b>3.4 %</b>	<b>3.7 %</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	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
<b>Sector Financiero**</b>	28	102	4256	3320	33	115	3809	3482	13	108	2490	1814
<b>Intragruppo y off-shore***</b>	0	0	1643	1853	0	0	1534	985	0	0	526	671
<b>Otros</b>	102	28	635	1361	115	33	918	1794	108	13	702	1234
<b>Total</b>	<b>130</b>	<b>130</b>	<b>6533</b>	<b>6533</b>	<b>148</b>	<b>148</b>	<b>6260</b>	<b>6260</b>	<b>121</b>	<b>121</b>	<b>3719</b>	<b>3719</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.