

Fecha de Publicación: 15 de abril de 2016

Fecha de Información: 13 de abril de miércoles <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\$1482.3 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 4.7%.<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	431.4	329.1	90.6	121.5	45.5	116.9	193.0
15-35	364.4	519.4	245.0	128.2	95.4	57.2	179.0
36-60	0.3	15.1	0.0	0.0	15.1	0.3	0.0
61-90	7.8	34.6	19.1	5.0	15.5	2.8	0.0
91-180	67.0	25.2	0.0	0.0	25.2	67.0	0.0
>180	45.2	54.9	0.2	5.0	14.7	0.2	40.0
<b>Total</b>	<b>916.1</b>	<b>978.2</b>	<b>354.8</b>	<b>259.7</b>	<b>211.4</b>	<b>244.4</b>	<b>412.0</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	3.7 %	4.7 %	4.3 %	4.2 %
15-35	4.4 %	5.0 %	4.6 %	4.8 %
36-60	-	6.0 %	3.8 %	6.0 %
61-90	-	6.1 %	5.0 %	5.7 %
91-180	-	6.5 %	5.3 %	5.7 %
>180	6.0 %	6.5 %	6.0 %	6.1 %
<b>Total</b>	<b>4.2 %</b>	<b>5.1 %</b>	<b>4.6 %</b>	<b>4.7 %</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	11 al 15 de abril				18 al 22 de abril				25 al 29 de abril			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
<b>Sector Financiero**</b>	35	116	4177	3818	13	113	2739	2124	51	166	3035	2244
<b>Intragrupa y off-shore***</b>	0	0	1658	1125	0	0	609	759	0	0	926	918
<b>Otros</b>	116	35	928	1821	113	13	798	1264	165	51	664	1464
<b>Total</b>	<b>151</b>	<b>151</b>	<b>6764</b>	<b>6764</b>	<b>126</b>	<b>126</b>	<b>4147</b>	<b>4147</b>	<b>217</b>	<b>217</b>	<b>4625</b>	<b>4625</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.