

**Fecha de Publicación: 18 de abril de 2016**

**Fecha de Información: 14 de abril 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\$1363.3 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 4.8%.<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	150.8	205.9	130.0	39.3	20.1	55.7	55.8
15-35	558.1	295.2	152.4	141.8	64.6	338.0	78.3
36-60	4.1	63.4	16.5	0.0	46.9	4.1	0.0
61-90	31.6	29.1	0.1	10.0	29.0	21.6	0.0
91-180	71.2	51.8	20.3	3.0	31.4	68.2	0.0
>180	21.1	35.0	0.0	0.0	15.0	1.1	20.0
<b>Total</b>	<b>836.9</b>	<b>680.5</b>	<b>319.3</b>	<b>194.1</b>	<b>207.1</b>	<b>488.8</b>	<b>154.1</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	4.7 %	4.9 %	3.3 %	4.2 %
15-35	4.9 %	4.8 %	4.4 %	4.6 %
36-60	-	5.2 %	4.6 %	5.2 %
61-90	-	6.0 %	5.3 %	5.6 %
91-180	-	6.0 %	5.5 %	5.7 %
>180	6.1 %	7.0 %	5.8 %	6.5 %
<b>Total</b>	<b>5.0 %</b>	<b>5.2 %</b>	<b>4.4 %</b>	<b>4.8 %</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	114	4222	3824	13	114	2809	2275	51	166	3082	2295
<b>Intragrupa y off-shore***</b>	0	0	1658	1159	0	0	713	765	0	0	953	918
<b>Otros</b>	114	35	931	1830	114	13	800	1282	166	51	680	1502
<b>Total</b>	<b>149</b>	<b>149</b>	<b>6812</b>	<b>6812</b>	<b>127</b>	<b>127</b>	<b>4323</b>	<b>4323</b>	<b>217</b>	<b>217</b>	<b>4716</b>	<b>4716</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.