

**Fecha de Publicación: 22 de abril de 2016**

**Fecha de Información: 20 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\$1163.2 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 5.4%.<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	112.6	137.0	96.0	45.6	31.0	57.0	10.0
15-35	515.2	205.5	107.3	166.0	68.3	319.3	29.9
36-60	6.7	14.3	0.0	0.0	13.7	6.1	0.6
61-90	13.0	32.2	0.0	5.0	31.6	7.4	0.6
91-180	68.3	29.0	0.9	0.0	27.5	67.7	0.6
>180	23.9	57.1	10.0	0.0	37.1	13.9	10.0
<b>Total</b>	<b>739.7</b>	<b>475.1</b>	<b>214.2</b>	<b>216.6</b>	<b>209.2</b>	<b>471.5</b>	<b>51.7</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	5.3 %	4.5 %	5.6 %	5.1 %
15-35	5.1 %	6.0 %	4.9 %	5.2 %
36-60	5.6 %	10.0 %	5.5 %	8.5 %
61-90	6.0 %	6.2 %	5.7 %	6.0 %
91-180	6.1 %	6.5 %	5.6 %	5.8 %
>180	6.1 %	6.4 %	4.6 %	6.0 %
<b>Total</b>	<b>5.4 %</b>	<b>5.9 %</b>	<b>5.1 %</b>	<b>5.4 %</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	18 al 22 de abril				25 al 29 de abril				2 al 6 de mayo			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
<b>Sector Financiero**</b>	27	112	3212	2752	52	182	3502	2925	317	166	3115	3114
<b>Intragruppo y off-shore***</b>	10	0	976	933	0	0	1295	1009	0	153	1680	991
<b>Otros</b>	102	27	871	1374	182	52	827	1691	166	165	516	1205
<b>Total</b>	<b>140</b>	<b>140</b>	<b>5059</b>	<b>5059</b>	<b>234</b>	<b>234</b>	<b>5625</b>	<b>5625</b>	<b>483</b>	<b>483</b>	<b>5311</b>	<b>5311</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.