

Fecha de Publicación: 27 de febrero de 2018

Fecha de Información: 23 de febrero de 2018 <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\$1567.2 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 0.8%.<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	337.5	240.7	167.3	245.1	12.4	31.5	61.0
15-35	330.0	418.2	277.8	160.9	26.5	55.2	114.0
36-60	61.9	70.4	0.0	0.0	10.4	1.9	60.0
61-90	80.2	68.1	0.0	30.0	18.1	0.2	50.0
91-180	1.8	29.2	0.0	0.0	29.2	1.8	0.0
>180	153.2	125.9	0.0	81.2	60.9	7.0	65.0
<b>Total</b>	<b>964.6</b>	<b>952.6</b>	<b>445.1</b>	<b>517.1</b>	<b>157.5</b>	<b>97.5</b>	<b>350.0</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 intragruppo		Total
	Compras/Ventas	Compras	Ventas	
3-14	0.1 %	0.3 %	0.3 %	0.3 %
15-35	0.4 %	0.6 %	0.6 %	0.6 %
36-60	0.5 %	2.2 %	0.8 %	0.7 %
61-90	1.4 %	1.6 %	1.4 %	1.5 %
91-180	-	2.1 %	1.4 %	2.1 %
>180	1.7 %	2.4 %	2.0 %	2.0 %
<b>Total</b>	<b>0.8 %</b>	<b>0.9 %</b>	<b>0.7 %</b>	<b>0.8 %</b>

\* Incluye solo operaciones interbancarias

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

**Cuadro No. 3**  
**Vencimientos de Forwards**

Sectores	19 al 23 de febrero				26 de feb. al 2 de marzo				5 al 9 de marzo			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
<b>Sector Financiero**</b>	10	294	4553	3750	9	124	6501	5725	9	105	3867	4095
<b>Intragruppo y off-shore***</b>	0	0	1511	1465	0	0	2322	2426	0	0	1606	1279
<b>Otros</b>	294	10	894	1744	124	9	1194	1866	105	9	1393	1492
<b>Total</b>	<b>304</b>	<b>304</b>	<b>6959</b>	<b>6959</b>	<b>132</b>	<b>132</b>	<b>10016</b>	<b>10016</b>	<b>114</b>	<b>114</b>	<b>6865</b>	<b>6865</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.

<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:  $((\text{Tasa Pactada} / \text{Tasa de Contado})^{\frac{360}{\text{Plazo}}}) - 1$ . Para el cálculo de la devaluación implícita se excluyen las operaciones intragruppo.