

Fecha de Publicación: 28 de febrero de 2018

Fecha de Información: 26 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\$1545.1 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 1.1%.<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	239.6	162.4	101.0	101.5	7.9	84.6	53.5
15-35	352.5	219.6	159.0	166.2	36.1	161.9	24.5
36-60	186.9	159.0	0.0	30.0	159.0	156.9	0.0
61-90	4.9	16.5	0.0	0.0	16.5	4.9	0.0
91-180	176.0	52.1	0.0	50.0	52.1	126.0	0.0
>180	46.4	12.2	0.0	40.0	7.2	1.4	5.0
<b>Total</b>	<b>1006.3</b>	<b>621.8</b>	<b>260.0</b>	<b>387.7</b>	<b>278.8</b>	<b>535.7</b>	<b>83.0</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	0.9 %	1.2 %	0.6 %	0.8 %
15-35	0.9 %	0.9 %	0.7 %	0.8 %
36-60	-	1.4 %	1.3 %	1.3 %
61-90	-	1.7 %	1.2 %	1.6 %
91-180	-	2.0 %	1.6 %	1.7 %
>180	2.1 %	2.2 %	2.2 %	2.2 %
<b>Total</b>	<b>1.0 %</b>	<b>1.3 %</b>	<b>1.1 %</b>	<b>1.1 %</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	26 de feb. al 2 de marzo				5 al 9 de marzo				12 al 16 de marzo			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
<b>Sector Financiero**</b>	8	119	6644	5864	15	105	3952	4104	23	112	4382	3446
<b>Intragrupa y off-shore***</b>	0	0	2413	2510	0	0	1606	1297	0	0	1343	1598
<b>Otros</b>	119	8	1189	1872	105	15	1402	1559	112	23	1116	1797
<b>Total</b>	<b>127</b>	<b>127</b>	<b>10246</b>	<b>10246</b>	<b>120</b>	<b>120</b>	<b>6960</b>	<b>6960</b>	<b>135</b>	<b>135</b>	<b>6841</b>	<b>6841</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: ((Tasa Pactada/Tasa de Contado) ^ (360/Plazo)) - 1. Para el cálculo de la devaluación implícita se excluyen las operaciones intragrupo.