

Fecha de Publicación: 5 de marzo de 2018

Fecha de Información: 01 de marzo 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\$1974.8 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 1.3%.<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	212.2	278.1	214.3	118.3	13.9	44.0	50.0
15-35	659.9	717.9	231.3	164.8	127.6	136.1	359.0
36-60	175.4	64.6	0.0	0.0	64.6	175.4	0.0
61-90	77.2	89.5	0.0	10.0	34.5	12.2	55.0
91-180	44.4	32.1	0.0	20.8	22.1	13.6	10.0
>180	85.6	91.8	0.0	0.0	11.8	5.6	80.0
<b>Total</b>	<b>1254.7</b>	<b>1274.1</b>	<b>445.6</b>	<b>313.8</b>	<b>274.5</b>	<b>386.9</b>	<b>554.0</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	1.4 %	1.3 %	1.2 %	1.3 %
15-35	1.3 %	1.3 %	1.1 %	1.3 %
36-60	-	1.2 %	1.2 %	1.2 %
61-90	1.6 %	1.4 %	1.3 %	1.4 %
91-180	1.8 %	2.3 %	1.8 %	2.0 %
>180	2.4 %	2.3 %	2.0 %	2.3 %
<b>Total</b>	<b>1.5 %</b>	<b>1.4 %</b>	<b>1.2 %</b>	<b>1.3 %</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	116	6968	6249	24	109	4222	4322	23	116	4728	3819
<b>Intragruppo y off-shore***</b>	0	0	2712	2739	0	0	1717	1446	0	0	1498	1716
<b>Otros</b>	116	8	1208	1899	109	24	1436	1607	116	23	1146	1837
<b>Total</b>	<b>125</b>	<b>125</b>	<b>10888</b>	<b>10888</b>	<b>133</b>	<b>133</b>	<b>7375</b>	<b>7375</b>	<b>139</b>	<b>139</b>	<b>7372</b>	<b>7372</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:  $((\text{Tasa Pactada} / \text{Tasa de Contado}) ^ \wedge (360 / \text{Plazo})) - 1$ . Para el cálculo de la devaluación implícita se excluyen las operaciones intragrupo.