

Fecha de Publicación: 12 de marzo de 2018

Fecha de Información: 08 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\$2418.4 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 0.6%.<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	616.8	456.5	202.8	325.3	110.7	148.5	143.0
15-35	440.2	780.7	443.0	80.5	129.8	151.8	207.9
36-60	84.7	90.8	55.0	0.0	0.8	49.7	35.0
61-90	32.2	2.5	1.6	30.0	0.9	2.2	0.0
91-180	79.3	68.1	56.6	70.0	11.5	9.3	0.0
>180	129.0	53.5	6.2	55.0	17.3	44.0	30.0
<b>Total</b>	<b>1382.2</b>	<b>1452.1</b>	<b>765.1</b>	<b>560.8</b>	<b>271.1</b>	<b>405.5</b>	<b>415.9</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	0.4 %	0.6 %	0.4 %	0.5 %
15-35	0.4 %	0.5 %	0.4 %	0.4 %
36-60	0.5 %	0.6 %	0.6 %	0.6 %
61-90	-	1.9 %	1.2 %	1.4 %
91-180	-	1.7 %	1.5 %	1.5 %
>180	1.9 %	2.0 %	1.8 %	1.8 %
<b>Total</b>	<b>0.5 %</b>	<b>0.6 %</b>	<b>0.7 %</b>	<b>0.6 %</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	5 al 9 de marzo				12 al 16 de marzo				19 al 23 de marzo			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
<b>Sector Financiero**</b>	35	111	5266	4878	17	123	5486	5247	17	118	3369	3007
<b>Intragruppo y off-shore***</b>	0	0	2049	2286	0	0	1854	1922	0	0	966	1084
<b>Otros</b>	111	35	1475	1625	123	17	1826	1996	118	17	1116	1360
<b>Total</b>	<b>146</b>	<b>146</b>	<b>8790</b>	<b>8790</b>	<b>140</b>	<b>140</b>	<b>9165</b>	<b>9165</b>	<b>135</b>	<b>135</b>	<b>5451</b>	<b>5451</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.