

**Fecha de Publicación: 14 de marzo de 2018**

**Fecha de Información: 12 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\$1493.0 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	335.4	343.8	162.7	169.5	57.1	41.9	124.0
15-35	401.4	476.1	134.0	125.5	215.1	148.9	127.0
36-60	111.0	6.9	0.0	0.0	6.9	111.0	0.0
61-90	7.8	4.2	0.0	0.0	4.2	7.8	0.0
91-180	8.6	19.3	0.0	0.0	19.3	8.6	0.0
>180	20.1	9.2	0.0	0.0	9.2	20.1	0.0
<b>Total</b>	<b>884.5</b>	<b>859.6</b>	<b>296.7</b>	<b>295.0</b>	<b>311.9</b>	<b>338.5</b>	<b>251.0</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	0.7 %	0.9 %	0.6 %	0.8 %
15-35	0.8 %	0.9 %	0.7 %	0.8 %
36-60	-	1.3 %	0.8 %	0.9 %
61-90	-	2.2 %	1.1 %	1.5 %
91-180	-	1.9 %	1.1 %	1.7 %
>180	-	2.3 %	1.6 %	1.8 %
<b>Total</b>	<b>0.8 %</b>	<b>1.0 %</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	12 al 16 de marzo				19 al 23 de marzo				26 al 30 de marzo			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
<b>Sector Financiero**</b>	18	134	5764	5695	22	119	3438	3094	11	104	2602	2532
<b>Intragruppo y off-shore***</b>	0	0	2182	2034	0	0	968	1096	0	0	1156	1268
<b>Otros</b>	134	18	1845	2061	119	22	1150	1367	103	11	507	464
<b>Total</b>	<b>152</b>	<b>152</b>	<b>9790</b>	<b>9790</b>	<b>141</b>	<b>141</b>	<b>5557</b>	<b>5557</b>	<b>115</b>	<b>115</b>	<b>4264</b>	<b>4264</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.