

Fecha de Publicación: 15 de marzo de 2018

Fecha de Información: 13 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\$2171.5 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 0.8%.<sup>2</sup>

**Cuadro No. 1**  
**Contratos Forwards Pactados**

Rango	Sector Financiero**		Intragrupo y Off-shore***		Otros Agentes		Interbancarios
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	633.8	458.8	216.0	333.2	36.8	94.6	206.0
15-35	492.5	398.5	85.4	148.3	209.1	240.2	104.0
36-60	161.4	109.3	1.3	10.0	108.0	151.4	0.0
61-90	0.2	49.4	0.0	0.0	49.4	0.2	0.0
91-180	23.8	88.3	45.0	0.0	37.9	18.4	5.4
>180	30.4	70.4	30.6	0.0	9.8	0.4	30.0
<b>Total</b>	<b>1342.1</b>	<b>1174.8</b>	<b>378.2</b>	<b>491.5</b>	<b>451.2</b>	<b>505.2</b>	<b>345.4</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	0.5 %	0.7 %	0.6 %	0.6 %
15-35	0.7 %	0.8 %	0.7 %	0.7 %
36-60	-	0.9 %	0.8 %	0.8 %
61-90	-	1.7 %	0.9 %	1.7 %
91-180	1.5 %	1.9 %	1.2 %	1.7 %
>180	1.9 %	2.0 %	1.7 %	1.9 %
<b>Total</b>	<b>0.7 %</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	135	6025	5938	23	119	3595	3223	12	102	2818	2637
<b>Intragrupo y off-shore***</b>	0	0	2364	2189	0	0	972	1117	0	0	1209	1426
<b>Otros</b>	135	18	1846	2107	119	23	1179	1407	102	12	509	473
<b>Total</b>	<b>153</b>	<b>153</b>	<b>10234</b>	<b>10234</b>	<b>141</b>	<b>141</b>	<b>5746</b>	<b>5746</b>	<b>115</b>	<b>115</b>	<b>4536</b>	<b>4536</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.