

Fecha de Publicación: 9 de abril de 2018

Fecha de Información: 05 de abril 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\$1804.7 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 1.2%.<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	196.3	196.7	105.5	105.0	41.2	41.3	50.0
15-35	437.4	569.2	288.8	15.0	177.5	319.4	103.0
36-60	153.3	157.1	0.0	0.0	157.1	153.3	0.0
61-90	97.2	44.3	5.0	26.3	14.2	45.9	25.0
91-180	50.3	49.7	18.6	30.0	11.0	0.3	20.0
>180	45.0	11.2	0.0	40.0	6.2	0.0	5.0
<b>Total</b>	<b>979.5</b>	<b>1028.1</b>	<b>417.9</b>	<b>216.3</b>	<b>407.2</b>	<b>560.2</b>	<b>203.0</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	1.3 %	1.4 %	1.2 %	1.3 %
15-35	1.3 %	1.3 %	0.9 %	1.1 %
36-60	-	0.9 %	0.8 %	0.9 %
61-90	1.6 %	2.1 %	1.6 %	1.7 %
91-180	1.7 %	2.3 %	1.7 %	1.8 %
>180	2.0 %	2.5 %	2.0 %	2.1 %
<b>Total</b>	<b>1.4 %</b>	<b>1.3 %</b>	<b>1.1 %</b>	<b>1.2 %</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	2 al 6 de abril				9 al 13 de abril				16 al 20 de abril			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
<b>Sector Financiero**</b>	25	131	4796	4893	17	148	3690	3454	26	119	3827	3275
<b>Intragrupo y off-shore***</b>	0	0	1717	1516	0	0	1077	1171	0	0	1107	1253
<b>Otros</b>	131	25	1323	1427	148	17	1230	1372	119	26	1212	1619
<b>Total</b>	<b>155</b>	<b>155</b>	<b>7836</b>	<b>7836</b>	<b>165</b>	<b>165</b>	<b>5997</b>	<b>5997</b>	<b>146</b>	<b>146</b>	<b>6147</b>	<b>6147</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.