

**Fecha de Publicación: 10 de abril de 2018**

**Fecha de Información: 06 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\$901.1 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 1.4%.<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	75.5	154.1	108.0	28.0	28.1	29.5	18.0
15-35	218.2	372.3	236.0	102.0	70.3	50.2	66.0
36-60	2.0	46.1	0.0	0.0	46.1	2.0	0.0
61-90	21.0	8.2	0.0	10.0	3.2	6.0	5.0
91-180	10.7	22.2	0.0	0.0	12.2	0.7	10.0
>180	55.0	29.8	12.0	40.0	2.8	0.0	15.0
<b>Total</b>	<b>382.4</b>	<b>632.7</b>	<b>356.0</b>	<b>180.0</b>	<b>162.7</b>	<b>88.4</b>	<b>114.0</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	
3-14	1.5 %	1.7 %	-2.0 %	0.5 %
15-35	1.2 %	1.6 %	1.4 %	1.5 %
36-60	-	2.0 %	1.1 %	1.9 %
61-90	1.7 %	2.5 %	1.7 %	1.9 %
91-180	1.8 %	2.2 %	1.9 %	2.1 %
>180	2.1 %	2.2 %	2.1 %	2.1 %
<b>Total</b>	<b>1.4 %</b>	<b>1.7 %</b>	<b>0.7 %</b>	<b>1.4 %</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	4892	21	146	3740	3550	26	120	3852	3333
<b>Intragrupo y off-shore***</b>	0	0	1717	1516	0	0	1139	1199	0	0	1153	1253
<b>Otros</b>	131	25	1322	1428	146	21	1250	1381	120	26	1220	1639
<b>Total</b>	<b>156</b>	<b>156</b>	<b>7836</b>	<b>7836</b>	<b>167</b>	<b>167</b>	<b>6130</b>	<b>6130</b>	<b>146</b>	<b>146</b>	<b>6225</b>	<b>6225</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.