

Fecha de Publicación: 12 de abril de 2018

Fecha de Información: 10 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\$2104.2 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 1.7%.<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	466.2	387.6	143.7	196.0	31.9	58.2	212.0
15-35	780.5	593.8	166.6	187.5	131.7	297.6	295.4
36-60	97.2	66.9	0.0	0.0	66.8	97.2	0.0
61-90	21.4	7.7	0.0	0.0	7.7	21.4	0.0
91-180	122.0	24.0	0.0	100.0	24.0	22.0	0.0
>180	22.3	27.2	0.0	10.0	22.2	7.3	5.0
<b>Total</b>	<b>1509.6</b>	<b>1107.2</b>	<b>310.3</b>	<b>493.5</b>	<b>284.4</b>	<b>503.6</b>	<b>512.5</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	1.8 %	1.8 %	1.4 %	1.7 %
15-35	1.7 %	1.9 %	1.6 %	1.7 %
36-60	2.0 %	1.9 %	1.7 %	1.7 %
61-90	-	2.0 %	1.7 %	1.8 %
91-180	-	2.4 %	1.9 %	2.0 %
>180	2.0 %	2.5 %	2.0 %	2.3 %
<b>Total</b>	<b>1.7 %</b>	<b>1.9 %</b>	<b>1.6 %</b>	<b>1.7 %</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	9 al 13 de abril				16 al 20 de abril				23 al 27 de abril			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
<b>Sector Financiero**</b>	21	156	4427	3967	27	121	3957	3602	7	199	4074	3589
<b>Intragruppo y off-shore***</b>	0	0	1303	1606	0	0	1330	1319	0	0	1054	1342
<b>Otros</b>	156	21	1274	1433	121	27	1282	1648	199	7	1522	1720
<b>Total</b>	<b>177</b>	<b>177</b>	<b>7005</b>	<b>7005</b>	<b>148</b>	<b>148</b>	<b>6569</b>	<b>6569</b>	<b>206</b>	<b>206</b>	<b>6650</b>	<b>6650</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 intragruppo.