

**Fecha de Publicación: 17 de abril de 2018**

**Fecha de Información: 13 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\$2000.8 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 1.0%.<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	250.0	295.1	159.2	78.0	48.0	84.0	88.0
15-35	439.6	695.9	387.0	162.0	140.9	109.6	168.0
36-60	59.9	39.1	0.0	0.0	9.1	29.9	30.0
61-90	77.3	50.4	0.0	33.0	17.9	11.8	32.5
91-180	124.4	89.1	0.2	51.6	18.9	2.7	70.1
>180	244.4	54.4	0.0	205.0	24.2	9.2	30.2
<b>Total</b>	<b>1195.6</b>	<b>1224.0</b>	<b>546.3</b>	<b>529.6</b>	<b>258.9</b>	<b>247.2</b>	<b>418.8</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	0.9 %		0.9 %	0.4 %	0.7 %
15-35	0.9 %		0.9 %	0.8 %	0.9 %
36-60	1.1 %		1.7 %	0.5 %	0.9 %
61-90	1.2 %		1.7 %	1.0 %	1.3 %
91-180	1.5 %		2.2 %	1.5 %	1.6 %
>180	1.9 %		2.4 %	1.9 %	2.0 %
<b>Total</b>	<b>1.1 %</b>		<b>1.1 %</b>	<b>1.0 %</b>	<b>1.0 %</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	145	4587	4108	31	128	4244	3905	8	203	4262	3730
<b>Intragrupo y off-shore***</b>	0	0	1352	1673	0	0	1516	1458	0	0	1089	1401
<b>Otros</b>	145	21	1292	1450	128	31	1318	1714	203	8	1568	1787
<b>Total</b>	<b>166</b>	<b>166</b>	<b>7231</b>	<b>7231</b>	<b>159</b>	<b>159</b>	<b>7078</b>	<b>7078</b>	<b>211</b>	<b>211</b>	<b>6918</b>	<b>6918</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.