

Fecha de Publicación: 20 de abril de 2018

Fecha de Información: 18 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\$1689.4 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 1.3%.<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	265.3	307.9	132.3	87.0	50.7	53.3	125.0
15-35	545.2	524.5	231.0	178.0	91.0	164.7	202.5
36-60	87.5	4.4	0.0	0.0	4.4	87.5	0.0
61-90	119.3	27.8	6.0	113.2	21.8	6.2	0.0
91-180	20.4	43.9	15.0	20.0	28.9	0.4	0.0
>180	50.6	30.0	0.0	35.0	20.0	5.6	10.0
<b>Total</b>	<b>1088.4</b>	<b>938.5</b>	<b>384.3</b>	<b>433.2</b>	<b>216.8</b>	<b>317.7</b>	<b>337.5</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 intragrupo		Total
	Compras/Ventas	Compras	Ventas	
3-14	1.1 %	1.2 %	1.2 %	1.2 %
15-35	1.3 %	1.3 %	1.1 %	1.3 %
36-60	-	1.8 %	1.2 %	1.3 %
61-90	-	1.7 %	1.3 %	1.6 %
91-180	-	2.1 %	1.5 %	1.9 %
>180	1.9 %	2.3 %	1.8 %	2.0 %
<b>Total</b>	<b>1.3 %</b>	<b>1.4 %</b>	<b>1.2 %</b>	<b>1.3 %</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	16 al 20 de abril				23 al 27 de abril				30 de abr. al 4 de mayo			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
<b>Sector Financiero**</b>	32	131	4823	4543	9	206	4465	4055	11	105	2975	2914
<b>Intragrupo y off-shore***</b>	0	0	1821	1690	0	0	1271	1463	0	0	898	697
<b>Otros</b>	131	32	1317	1728	206	9	1622	1840	105	11	1047	1309
<b>Total</b>	<b>163</b>	<b>163</b>	<b>7961</b>	<b>7961</b>	<b>214</b>	<b>214</b>	<b>7358</b>	<b>7358</b>	<b>116</b>	<b>116</b>	<b>4920</b>	<b>4920</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:  $((\text{Tasa Pactada}/\text{Tasa de Contado})^{\wedge} (360/\text{Plazo})) - 1$ . Para el cálculo de la devaluación implícita se excluyen las operaciones intragrupo.