

Fecha de Publicación: 26 de abril de 2018

Fecha de Información: 24 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\$1698.7 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	193.5	186.9	128.3	116.7	18.6	36.8	40.0
15-35	550.2	369.8	218.5	215.8	87.3	270.5	64.0
36-60	258.0	155.5	0.0	0.9	108.0	209.6	47.5
61-90	5.6	5.7	0.0	0.0	5.7	5.6	0.0
91-180	61.1	76.9	0.3	0.0	21.6	6.1	55.0
>180	34.9	32.0	0.0	0.0	7.0	9.9	25.0
<b>Total</b>	<b>1103.3</b>	<b>826.9</b>	<b>347.1</b>	<b>333.4</b>	<b>248.3</b>	<b>538.5</b>	<b>231.5</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	1.8 %	1.3 %	-0.1 %	0.7 %
15-35	1.2 %	1.2 %	0.9 %	1.0 %
36-60	1.2 %	1.3 %	1.0 %	1.1 %
61-90	-	1.9 %	0.7 %	1.3 %
91-180	1.2 %	2.1 %	1.1 %	1.4 %
>180	1.8 %	2.3 %	1.3 %	1.7 %
<b>Total</b>	<b>1.4 %</b>	<b>1.3 %</b>	<b>0.7 %</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	23 al 27 de abril				30 de abr. al 4 de mayo				7 al 11 de mayo			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
<b>Sector Financiero**</b>	36	217	5158	4563	16	104	3192	3250	8	112	3742	3669
<b>Intragrupo y off-shore***</b>	0	0	1661	1977	0	0	1085	709	0	0	1383	1099
<b>Otros</b>	217	36	1638	1916	104	16	1084	1402	112	8	1383	1740
<b>Total</b>	<b>253</b>	<b>253</b>	<b>8457</b>	<b>8457</b>	<b>120</b>	<b>120</b>	<b>5361</b>	<b>5361</b>	<b>121</b>	<b>121</b>	<b>6508</b>	<b>6508</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:  $((\text{Tasa Pactada}/\text{Tasa de Contado})^{\frac{360}{\text{Plazo}}}) - 1$ . Para el cálculo de la devaluación implícita se excluyen las operaciones intragrupo.