

Fecha de Publicación: 27 de abril de 2018

Fecha de Información: 25 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\$1698.2 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 1.1%.<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	245.4	185.4	130.5	144.0	35.4	81.9	19.5
15-35	410.1	661.9	394.1	135.0	108.3	115.6	159.5
36-60	122.7	84.0	0.0	0.0	84.0	122.7	0.0
61-90	60.3	35.8	15.0	35.0	5.8	10.3	15.0
91-180	22.9	19.4	5.0	21.5	14.4	1.4	0.0
>180	12.5	31.9	11.0	10.5	20.9	2.0	0.0
<b>Total</b>	<b>873.9</b>	<b>1018.4</b>	<b>555.6</b>	<b>346.0</b>	<b>268.8</b>	<b>333.8</b>	<b>194.0</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	Compras	Ventas	
3-14	0.8 %	1.2 %	0.7 %	0.9 %
15-35	0.9 %	1.2 %	0.9 %	1.0 %
36-60	-	1.3 %	1.1 %	1.2 %
61-90	1.0 %	1.2 %	1.0 %	1.1 %
91-180	-	1.8 %	1.2 %	1.5 %
>180	-	1.9 %	1.3 %	1.9 %
<b>Total</b>	<b>0.9 %</b>	<b>1.2 %</b>	<b>0.9 %</b>	<b>1.1 %</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
Sector Financiero**	38	202	5212	4713	28	104	3258	3283	8	114	3863	3717
Intragrupo y off-shore***	0	0	1787	2028	0	0	1085	726	0	0	1388	1175
Otros	202	38	1657	1915	104	28	1102	1436	114	8	1416	1775
<b>Total</b>	<b>240</b>	<b>240</b>	<b>8656</b>	<b>8656</b>	<b>132</b>	<b>132</b>	<b>5444</b>	<b>5444</b>	<b>122</b>	<b>122</b>	<b>6668</b>	<b>6668</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.