

Fecha de Publicación: 3 de mayo de 2018

Fecha de Información: 30 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\$1676.3 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 0.5%.<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	312.1	110.3	63.0	280.5	33.3	17.6	14.0
15-35	384.2	503.5	297.8	168.0	150.8	161.2	55.0
36-60	55.0	80.6	39.7	0.0	12.9	27.0	28.0
61-90	9.0	35.5	0.0	0.0	35.5	9.0	0.0
91-180	66.4	58.8	40.0	55.0	18.8	11.4	0.0
>180	50.2	107.7	90.0	28.0	17.7	22.2	0.0
<b>Total</b>	<b>876.8</b>	<b>896.4</b>	<b>530.4</b>	<b>531.5</b>	<b>269.0</b>	<b>248.3</b>	<b>97.0</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 intragruppo		Total
	Compras/Ventas	Compras	Ventas	
3-14	0.4 %	0.7 %	0.2 %	0.4 %
15-35	0.3 %	0.5 %	0.3 %	0.4 %
36-60	0.6 %	0.8 %	0.5 %	0.6 %
61-90	-	1.5 %	0.6 %	1.3 %
91-180	-	1.1 %	0.8 %	1.0 %
>180	-	1.4 %	1.1 %	1.3 %
<b>Total</b>	<b>0.4 %</b>	<b>0.7 %</b>	<b>0.4 %</b>	<b>0.5 %</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

Sector	30 de abr. al 4 de mayo				7 al 11 de mayo				14 al 18 de mayo			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	35	107	3616	3562	22	114	4172	3869	17	128	3349	3219
Intragruppo y off-shore***	0	0	1256	1000	0	0	1405	1364	0	0	1245	718
Otros	107	35	1156	1466	114	22	1509	1854	128	17	956	1614
<b>Total</b>	<b>142</b>	<b>142</b>	<b>6028</b>	<b>6028</b>	<b>135</b>	<b>135</b>	<b>7087</b>	<b>7087</b>	<b>144</b>	<b>144</b>	<b>5550</b>	<b>5550</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 intragruppo.