

Fecha de Publicación: 9 de mayo de 2018

Fecha de Información: 07 de mayo 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\$1940.2 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 0.8%.<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	424.8	431.7	169.9	112.5	51.3	101.8	210.5
15-35	600.5	537.3	125.2	121.5	243.6	310.5	168.5
36-60	56.5	66.0	10.0	0.0	46.0	46.5	10.0
61-90	56.6	14.9	0.0	34.0	4.9	12.6	10.0
91-180	2.4	61.6	38.3	0.6	23.3	1.8	0.0
>180	72.7	39.3	10.0	9.4	4.3	38.3	25.0
<b>Total</b>	<b>1213.5</b>	<b>1150.7</b>	<b>353.4</b>	<b>278.0</b>	<b>373.3</b>	<b>511.5</b>	<b>424.0</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	0.9 %	0.7 %	0.6 %	0.7 %
15-35	0.9 %	0.9 %	0.6 %	0.8 %
36-60	1.0 %	1.0 %	0.8 %	0.9 %
61-90	1.0 %	1.2 %	0.9 %	1.0 %
91-180	-	1.5 %	0.5 %	1.4 %
>180	1.7 %	1.8 %	1.3 %	1.5 %
<b>Total</b>	<b>0.9 %</b>	<b>0.9 %</b>	<b>0.7 %</b>	<b>0.8 %</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	7 al 11 de mayo				14 al 18 de mayo				21 al 25 de mayo			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	35	114	4795	4564	20	133	3958	3785	35	137	3576	3741
Intragrupo y off-shore***	0	0	1721	1609	0	0	1301	837	0	0	1462	903
Otros	113	35	1620	1963	133	20	1040	1677	137	35	1448	1841
<b>Total</b>	<b>149</b>	<b>149</b>	<b>8136</b>	<b>8136</b>	<b>153</b>	<b>153</b>	<b>6299</b>	<b>6299</b>	<b>173</b>	<b>173</b>	<b>6486</b>	<b>6486</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.