

Fecha de Publicación: 11 de mayo de 2018

Fecha de Información: 09 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\$1832.4 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	253.4	399.3	229.2	91.5	52.1	43.9	118.0
15-35	511.6	500.2	239.5	178.5	49.2	121.6	211.5
36-60	25.8	12.9	0.0	0.0	12.9	25.8	0.0
61-90	134.2	87.1	13.0	0.0	44.1	104.2	30.0
91-180	40.1	56.9	24.2	25.0	22.8	5.1	10.0
>180	167.7	44.7	10.0	35.0	2.7	100.7	32.0
<b>Total</b>	<b>1132.9</b>	<b>1101.1</b>	<b>515.9</b>	<b>330.0</b>	<b>183.7</b>	<b>401.4</b>	<b>401.5</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	1.5 %	1.2 %	1.1 %	1.2 %
15-35	1.3 %	1.4 %	1.1 %	1.3 %
36-60	-	2.2 %	1.1 %	1.4 %
61-90	1.2 %	1.3 %	1.1 %	1.2 %
91-180	1.2 %	1.8 %	0.9 %	1.5 %
>180	1.8 %	1.7 %	1.3 %	1.5 %
<b>Total</b>	<b>1.4 %</b>	<b>1.4 %</b>	<b>1.1 %</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	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**	36	111	5093	4862	23	131	4110	3993	37	138	3696	4025
Intragrupo y off-shore***	0	0	1900	1800	0	0	1403	862	0	0	1636	930
Otros	111	36	1628	1959	131	23	1093	1751	138	37	1495	1871
<b>Total</b>	<b>147</b>	<b>147</b>	<b>8621</b>	<b>8621</b>	<b>154</b>	<b>154</b>	<b>6606</b>	<b>6606</b>	<b>175</b>	<b>175</b>	<b>6827</b>	<b>6827</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.