

Fecha de Publicación: 12 de febrero de 2018

Fecha de Información: 08 de febrero de 2018 <sup>1</sup>

## INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS<sup>2</sup>

Según el reporte de los Intermediarios del Mercado Cambiario durante el día se pactó un total de US\$2164.5 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 2.2%.<sup>3</sup>

**Cuadro No. 1**  
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero**		Intragrupa y Off-shore***		Otros Agentes		Interbancarios
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	213.3	293.3	106.2	12.7	71.5	85.1	115.5
15-35	715.0	770.6	500.0	161.8	97.3	380.0	173.2
36-60	17.1	32.9	13.6	0.0	15.6	13.4	3.7
61-90	112.4	55.2	0.0	55.0	15.2	17.4	40.0
91-180	138.5	33.7	0.0	60.0	28.7	73.5	5.0
>180	82.3	37.6	20.0	20.0	17.6	62.3	0.0
<b>Total</b>	<b>1278.7</b>	<b>1223.2</b>	<b>639.9</b>	<b>309.5</b>	<b>245.9</b>	<b>631.7</b>	<b>337.4</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	2.3 %	2.2 %	1.5 %	2.0 %
15-35	2.2 %	2.3 %	2.0 %	2.1 %
36-60	2.2 %	2.7 %	2.1 %	2.4 %
61-90	2.5 %	2.7 %	2.3 %	2.4 %
91-180	2.5 %	2.7 %	2.4 %	2.5 %
>180	-	2.7 %	2.5 %	2.5 %
<b>Total</b>	<b>2.3 %</b>	<b>2.3 %</b>	<b>2.1 %</b>	<b>2.2 %</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	5 al 9 de febrero				12 al 16 de febrero				19 al 23 de febrero			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
<b>Sector Financiero**</b>	23	97	5467	4700	25	144	5258	4617	11	265	3574	2894
<b>Intragrupa y off-shore***</b>	0	0	2027	1768	3	0	1432	1712	0	0	1095	1021
<b>Otros</b>	97	23	1241	2268	141	25	1312	1673	265	11	846	1599
<b>Total</b>	<b>120</b>	<b>120</b>	<b>8736</b>	<b>8736</b>	<b>169</b>	<b>169</b>	<b>8002</b>	<b>8002</b>	<b>276</b>	<b>276</b>	<b>5514</b>	<b>5514</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> Nota: Los reportes publicados entre el 5 y el 15 de febrero de 2018 fueron corregidos respecto a la primera publicación debido a errores del sistema.

<sup>3</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: ((Tasa Pactada/Tasa de Contado) ^ (360/Plazo)) - 1. Para el cálculo de la devaluación implícita se excluyen las operaciones intragrupo.