**Fecha de Publicación: 2 de mayo de 2018**

**Fecha de Información: 27 de abril de 2018** [1]

## INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Según el reporte de los Intermediarios del Mercado Cambiario durante el día se pactó un total de US$1674.5 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 0.7%.[2]

**Cuadro No. 1**
**Contratos Forwards Pactados**

| Rango | Sector Financiero** | | Intragrupo y Off-shore*** | | Otros Agentes | | Interbancarios |
|---|---|---|---|---|---|---|---|
| | Compras | Ventas | Compras | Ventas | Compras | Ventas | |
| 3-14 | 135.6 | 233.2 | 108.5 | 49.5 | 87.2 | 48.6 | 37.5 |
| 15-35 | 555.2 | 626.9 | 226.9 | 183.8 | 175.8 | 147.2 | 224.2 |
| 36-60 | 49.0 | 61.8 | 0.0 | 0.0 | 61.8 | 49.0 | 0.0 |
| 61-90 | 50.7 | 16.5 | 0.0 | 50.0 | 16.5 | 0.7 | 0.0 |
| 91-180 | 12.6 | 35.2 | 8.4 | 10.0 | 26.8 | 2.6 | 0.0 |
| >180 | 152.8 | 31.8 | 0.0 | 22.0 | 6.8 | 105.8 | 25.0 |
| **Total** | **955.8** | **1005.4** | **343.8** | **315.3** | **374.9** | **353.9** | **286.7** |

* 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 | 0.3 % | 0.7 % | 0.4 % | 0.6 % |
| 15-35 | 0.4 % | 0.7 % | 0.5 % | 0.5 % |
| 36-60 | - | 1.3 % | 0.5 % | 1.0 % |
| 61-90 | - | 1.3 % | 0.7 % | 0.9 % |
| 91-180 | - | 2.0 % | 0.7 % | 1.9 % |
| >180 | 1.3 % | 1.7 % | 1.2 % | 1.3 % |
| **Total** | 0.5 % | 0.9 % | 0.6 % | 0.7 % |

*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 | 5293 | 4793 | 35 | 105 | 3401 | 3501 | 20 | 114 | 4078 | 3822 |
| **Intragrupo y off-shore***** | 0 | 0 | 1847 | 2083 | 0 | 0 | 1209 | 795 | 0 | 0 | 1389 | 1288 |
| **Otros** | 202 | 38 | 1660 | 1924 | 105 | 35 | 1147 | 1461 | 114 | 20 | 1487 | 1844 |
| **Total** | **240** | **240** | **8800** | **8800** | **140** | **140** | **5757** | **5757** | **134** | **134** | **6954** | **6954** |

* 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.

[1] Datos provisionales.

[2] 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.