

**Fecha de Publicación: 24 de mayo de 2017**

**Fecha de Información: 22 de mayo de lunes<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\$1121.5 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 6.3%.<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	178.3	146.7	18.0	46.0	79.7	83.3	49.0
15-35	315.1	491.6	330.5	55.7	48.1	146.4	113.0
36-60	14.1	31.8	10.0	0.0	21.8	14.1	0.0
61-90	11.6	3.4	0.0	0.0	3.4	11.6	0.0
91-180	35.2	39.8	0.0	0.0	39.8	35.2	0.0
>180	6.8	14.2	0.0	0.0	9.2	1.8	5.0
<b>Total</b>	<b>561.1</b>	<b>727.4</b>	<b>358.5</b>	<b>101.7</b>	<b>201.9</b>	<b>292.4</b>	<b>167.0</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	6.5 %		6.6 %	6.1 %	6.4 %
15-35	6.0 %		6.6 %	6.1 %	6.3 %
36-60	-		6.6 %	5.9 %	6.4 %
61-90	-		6.3 %	5.6 %	5.7 %
91-180	-		5.7 %	5.4 %	5.5 %
>180	5.2 %		5.3 %	4.6 %	5.2 %
<b>Total</b>	<b>6.1 %</b>		<b>6.5 %</b>	<b>6.0 %</b>	<b>6.3 %</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	22 al 26 de mayo				29 de may. al 2 de junio				5 al 9 de junio			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	16	188	3471	3804	13	91	2134	2558	15	99	2750	2661
Intragrupo y off-shore***	0	0	1925	1171	0	0	1277	503	0	0	1172	786
Otros	188	16	801	1221	91	13	507	856	99	15	479	954
<b>Total</b>	<b>204</b>	<b>204</b>	<b>6197</b>	<b>6197</b>	<b>104</b>	<b>104</b>	<b>3917</b>	<b>3917</b>	<b>115</b>	<b>115</b>	<b>4400</b>	<b>4400</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:  $((Tasa Pactada/Tasa de Contado) ^ (360/Plazo)) - 1$ . Para el cálculo de la devaluación implícita se excluyen las operaciones intragrupo.