

**Fecha de Publicación: 2 de junio de 2017**

**Fecha de Información: 31 de mayo de miércoles <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\$1523.5 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 6.0%.<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	322.7	302.2	105.5	151.3	51.7	26.5	145.0
15-35	388.3	487.8	284.0	102.3	132.3	214.5	71.5
36-60	4.6	15.7	0.0	0.0	15.7	4.6	0.0
61-90	7.9	11.0	0.0	0.0	11.0	7.9	0.0
91-180	134.8	54.1	10.0	115.0	29.1	4.8	15.0
>180	11.8	14.0	0.0	10.0	14.0	1.8	0.0
<b>Total</b>	<b>870.1</b>	<b>884.9</b>	<b>399.5</b>	<b>378.5</b>	<b>253.9</b>	<b>260.1</b>	<b>231.5</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	6.0 %		6.4 %	4.9 %	5.7 %
15-35	6.1 %		6.3 %	6.2 %	6.2 %
36-60	-		6.5 %	5.8 %	6.4 %
61-90	-		6.1 %	5.4 %	5.8 %
91-180	5.5 %		5.7 %	5.3 %	5.4 %
>180	-		5.1 %	4.6 %	4.9 %
<b>Total</b>	<b>6.0 %</b>		<b>6.2 %</b>	<b>5.6 %</b>	<b>6.0 %</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	29 de may. al 2 de junio				5 al 9 de junio				12 al 16 de junio			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	29	84	3138	3194	21	98	3413	3393	21	113	3080	2842
Intragrupo y off-shore***	0	0	1485	1092	0	0	1429	945	0	0	1627	1361
Otros	84	29	608	944	98	21	676	1180	113	21	597	1101
<b>Total</b>	<b>113</b>	<b>113</b>	<b>5231</b>	<b>5231</b>	<b>120</b>	<b>120</b>	<b>5518</b>	<b>5518</b>	<b>134</b>	<b>134</b>	<b>5304</b>	<b>5304</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.