

**Fecha de Publicación: 8 de junio de 2017**

**Fecha de Información: 06 de junio de martes<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\$1412.4 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 5.9%.<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	313.7	224.3	86.0	155.0	3.3	23.7	135.0
15-35	443.3	623.3	346.5	82.5	81.4	165.5	195.4
36-60	60.1	18.4	0.0	40.0	3.4	5.1	15.0
61-90	1.6	1.6	0.0	0.0	1.6	1.6	0.0
91-180	24.7	30.4	0.0	16.0	22.4	0.7	8.0
>180	5.8	18.4	0.0	0.0	18.4	5.8	0.0
<b>Total</b>	<b>849.3</b>	<b>916.4</b>	<b>432.5</b>	<b>293.5</b>	<b>130.6</b>	<b>202.4</b>	<b>353.4</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	
3-14	6.0 %	6.0 %	6.1 %	6.1 %
15-35	5.9 %	6.0 %	5.8 %	5.9 %
36-60	5.8 %	6.1 %	5.8 %	5.8 %
61-90	-	5.7 %	5.7 %	5.7 %
91-180	5.5 %	5.3 %	5.5 %	5.4 %
>180	-	4.8 %	4.1 %	4.6 %
<b>Total</b>	<b>5.9 %</b>	<b>5.9 %</b>	<b>5.9 %</b>	<b>5.9 %</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 junio				12 al 16 de junio				19 al 23 de junio			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	20	116	4077	3894	22	116	3491	3421	23	90	2281	2538
Intragrupo y off-shore***	0	0	1762	1373	0	0	2020	1542	0	0	1249	658
Otros	116	20	703	1275	116	22	608	1156	90	23	601	935
<b>Total</b>	<b>136</b>	<b>136</b>	<b>6542</b>	<b>6542</b>	<b>137</b>	<b>137</b>	<b>6119</b>	<b>6119</b>	<b>113</b>	<b>113</b>	<b>4131</b>	<b>4131</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.