**Fecha de Publicación: 1 de junio de 2017**

**Fecha de Información: 30 de mayo de martes [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$1602.8 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 6.5%.[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 | 287.2 | 213.1 | 107.9 | 154.8 | 42.2 | 69.4 | 63.0 |
| 15-35 | 468.1 | 547.5 | 315.2 | 240.7 | 110.8 | 105.9 | 121.5 |
| 36-60 | 5.9 | 11.6 | 0.0 | 0.0 | 7.6 | 1.9 | 4.0 |
| 61-90 | 15.3 | 90.2 | 77.8 | 0.0 | 12.4 | 15.3 | 0.0 |
| 91-180 | 82.0 | 52.6 | 10.0 | 61.1 | 22.6 | 0.9 | 20.0 |
| >180 | 20.4 | 32.4 | 0.0 | 0.0 | 17.4 | 5.4 | 15.0 |
| **Total** | **878.9** | **947.4** | **510.9** | **456.6** | **213.0** | **198.8** | **223.5** |

* 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 | 6.6 % | 7.7 % | 6.7 % | 7.0 % |
| 15-35 | 6.6 % | 6.6 % | 6.2 % | 6.5 % |
| 36-60 | 5.9 % | 7.1 % | 5.9 % | 6.6 % |
| 61-90 | - | 6.2 % | 5.6 % | 5.9 % |
| 91-180 | 5.7 % | 5.5 % | 5.5 % | 5.5 % |
| >180 | 4.6 % | 5.0 % | 3.9 % | 4.7 % |
| **Total** | 6.4 % | 6.7 % | 6.2 % | 6.5 % |

*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 | 83 | 2965 | 3102 | 21 | 98 | 3274 | 3223 | 20 | 112 | 3034 | 2662 |
| **Intragrupo y off-shore***** | 0 | 0 | 1435 | 966 | 0 | 0 | 1398 | 919 | 0 | 0 | 1479 | 1340 |
| **Otros** | 83 | 29 | 611 | 942 | 98 | 21 | 627 | 1156 | 112 | 20 | 584 | 1095 |
| **Total** | **112** | **112** | **5011** | **5011** | **119** | **119** | **5299** | **5299** | **132** | **132** | **5098** | **5098** |

* 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.