Fecha de Publicación: 5 de junio de 2017

Fecha de Información: 01 de junio de jueves [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$1559.4 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 6.1%.[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	371.9	376.0	214.8	179.5	26.2	57.4	135.0
15-35	433.6	352.6	160.0	247.7	67.6	60.9	125.0
36-60	4.9	12.5	0.0	0.0	12.5	4.9	0.0
61-90	34.9	128.1	0.0	0.0	128.1	34.9	0.0
91-180	30.2	78.7	0.0	0.0	68.7	20.2	10.0
>180	0.0	6.1	0.0	0.0	6.1	0.0	0.0
Total	**875.5**	**953.9**	**374.8**	**427.2**	**309.1**	**178.3**	**270.0**

* 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	6.1 %	6.0 %	6.5 %	6.2 %
15-35	6.0 %	6.2 %	5.9 %	6.0 %
36-60	-	6.3 %	5.2 %	6.0 %
61-90	-	6.2 %	5.4 %	6.0 %
91-180	5.6 %	5.4 %	5.4 %	5.4 %
>180	-	5.1 %	4.9 %	5.1 %
Total	6.0 %	6.0 %	6.1 %	6.1 %

*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	87	3198	3243	21	101	3635	3498	22	115	3252	3077
Intragrupo y off-shore***	0	0	1513	1138	0	0	1458	1058	0	0	1784	1448
Otros	87	29	608	938	101	21	696	1234	115	22	600	1112
Total	**116**	**116**	**5319**	**5319**	**122**	**122**	**5789**	**5789**	**137**	**137**	**5636**	**5636**

* 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.