Fecha de Publicación: 6 de junio de 2017

Fecha de Información: 02 de junio de viernes [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$1158.0 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	160.8	256.0	183.5	93.0	22.5	17.8	50.0
15-35	341.3	326.4	174.8	201.5	70.7	58.8	81.0
36-60	0.4	10.0	0.0	0.0	10.0	0.4	0.0
61-90	38.3	11.3	0.0	30.0	9.7	6.7	1.6
91-180	46.9	53.0	10.0	45.0	41.2	0.1	1.8
>180	10.2	37.7	20.0	10.0	17.7	0.2	0.0
Total	**597.9**	**694.4**	**388.3**	**379.5**	**171.8**	**84.1**	**134.4**

* 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 %	6.1 %	5.5 %	5.9 %
15-35	6.1 %	7.2 %	6.0 %	6.6 %
36-60	-	6.3 %	5.4 %	6.3 %
61-90	5.7 %	6.0 %	5.4 %	5.5 %
91-180	5.1 %	5.4 %	5.5 %	5.5 %
>180	-	5.0 %	4.9 %	4.9 %
Total	6.1 %	6.5 %	5.7 %	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	86	3198	3243	20	102	3734	3660	22	116	3317	3168
Intragrupo y off-shore***	0	0	1513	1138	0	0	1594	1127	0	0	1831	1472
Otros	86	29	608	938	102	20	712	1253	116	22	605	1112
Total	**116**	**116**	**5319**	**5319**	**122**	**122**	**6040**	**6040**	**137**	**137**	**5753**	**5753**

* 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.