Fecha de Publicación: 7 de junio de 2017

Fecha de Información: 05 de junio de lunes [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$1148.0 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 5.9%.[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	223.3	293.7	271.0	161.0	1.6	41.2	21.1
15-35	322.8	206.7	92.0	115.5	48.7	141.3	66.0
36-60	63.8	68.7	0.1	0.0	65.6	60.8	3.0
61-90	9.8	10.9	0.1	0.0	10.8	9.8	0.0
91-180	3.8	24.4	0.3	0.0	24.1	3.8	0.0
>180	0.5	9.7	0.0	0.0	9.7	0.5	0.0
Total	**624.0**	**614.1**	**363.5**	**276.5**	**160.5**	**257.4**	**90.1**

* 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	6.2 %	6.1 %	5.7 %	5.9 %
15-35	6.1 %	5.9 %	5.9 %	5.9 %
36-60	5.9 %	6.0 %	5.8 %	5.9 %
61-90	-	5.8 %	5.4 %	5.6 %
91-180	-	5.5 %	5.4 %	5.5 %
>180	-	5.1 %	4.9 %	5.1 %
Total	6.1 %	6.0 %	5.8 %	5.9 %

*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	114	3908	3811	22	116	3366	3298	23	90	2203	2456
Intragrupo y off-shore***	0	0	1737	1264	0	0	1959	1496	0	0	1226	645
Otros	114	20	699	1270	116	22	605	1137	90	23	593	920
Total	**134**	**134**	**6345**	**6345**	**137**	**137**	**5931**	**5931**	**113**	**113**	**4022**	**4022**

* 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.