Fecha de Publicación: 12 de junio de 2017

Fecha de Información: 08 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$1462.3 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 5.7%.[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	222.9	174.1	104.5	131.9	19.6	40.9	50.0
15-35	409.1	542.1	314.1	92.5	90.5	179.1	137.5
36-60	2.4	1.6	0.0	0.0	1.6	2.4	0.0
61-90	16.0	6.3	3.0	10.0	3.3	6.0	0.0
91-180	127.9	92.6	0.2	37.0	82.4	80.9	10.0
>180	62.9	8.0	0.0	25.0	2.0	31.9	6.0
Total	**841.1**	**824.7**	**421.8**	**296.4**	**199.4**	**341.2**	**203.5**

* 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	6.0 %	6.1 %	5.9 %	6.0 %
15-35	5.9 %	5.8 %	5.8 %	5.8 %
36-60	-	6.1 %	5.0 %	5.4 %
61-90	-	5.7 %	5.4 %	5.5 %
91-180	5.3 %	5.4 %	5.3 %	5.4 %
>180	4.2 %	4.9 %	4.7 %	4.7 %
Total	5.8 %	5.8 %	5.6 %	5.7 %

*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	4331	3981	23	114	3842	3743	23	90	2374	2696
Intragrupo y off-shore***	0	0	1849	1614	0	0	2120	1634	0	0	1333	677
Otros	114	20	702	1287	114	23	699	1285	90	23	623	958
Total	**135**	**135**	**6883**	**6883**	**137**	**137**	**6661**	**6661**	**112**	**112**	**4331**	**4331**

* 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.