

Fecha de Publicación: 15 de enero de 2016

Fecha de Información: 13 de enero de miércoles 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\$1428.6 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 3.8%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

| Rango | Sector Financiero** | | Intragruppo y Off-shore*** | | Otros Agentes | | Interbancarios |
|--------------|---------------------|--------------|----------------------------|--------------|---------------|--------------|----------------|
| | Compras | Ventas | Compras | Ventas | Compras | Ventas | |
| 3-14 | 403.0 | 357.2 | 82.7 | 119.2 | 27.4 | 36.8 | 247.0 |
| 15-35 | 449.0 | 415.7 | 235.2 | 162.0 | 83.1 | 189.7 | 97.4 |
| 36-60 | 22.3 | 42.9 | 0.0 | 0.0 | 22.3 | 1.7 | 20.6 |
| 61-90 | 22.6 | 46.0 | 0.0 | 0.0 | 35.0 | 11.6 | 11.0 |
| 91-180 | 20.8 | 14.4 | 0.0 | 0.0 | 14.4 | 20.8 | 0.0 |
| >180 | 1.8 | 8.9 | 0.4 | 0.0 | 8.4 | 1.8 | 0.0 |
| Total | 919.6 | 885.0 | 318.4 | 281.2 | 190.7 | 262.4 | 376.0 |

* 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 | 3.3 % | 1.7 % | 3.2 % | 2.9 % |
| 15-35 | 4.0 % | 4.9 % | 3.9 % | 4.3 % |
| 36-60 | 4.3 % | 4.4 % | 3.6 % | 4.3 % |
| 61-90 | 4.4 % | 5.0 % | 4.3 % | 4.7 % |
| 91-180 | - | 5.3 % | 4.5 % | 4.9 % |
| >180 | - | 4.5 % | 4.7 % | 4.5 % |
| Total | 3.6 % | 4.1 % | 3.8 % | 3.8 % |

*Incluye solo operaciones interbancarias

En el cuadro No. 3 se presentan los vencimientos de forwards para ésta y las próximas dos semanas.

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: $((\text{Tasa Pactada}/\text{Tasa de Contado}) \wedge (360/\text{Plazo})) - 1$. Para el cálculo de la devaluación implícita se excluyen las operaciones intragrupo.

Cuadro No. 3
Vencimientos de Forwards

| Sector | 11 al 15 de enero | | | | 18 al 22 de enero | | | | 25 al 29 de enero | | | |
|-----------------------------------|-------------------|------------|-------------|-------------|-------------------|------------|-------------|-------------|-------------------|------------|-------------|-------------|
| | Delivery | | NDF | | Delivery | | NDF | | Delivery | | NDF | |
| | C | V | C | V | C | V | C | V | C | V | C | V |
| Sector Financiero** | 55 | 135 | 2987 | 3090 | 10 | 140 | 2343 | 2319 | 12 | 122 | 2115 | 1537 |
| Intragruppo y off-shore*** | 0 | 0 | 1453 | 976 | 0 | 0 | 1194 | 472 | 0 | 0 | 662 | 394 |
| Otros | 135 | 55 | 748 | 1122 | 140 | 10 | 437 | 1182 | 121 | 12 | 528 | 1374 |
| Total | 190 | 190 | 5188 | 5188 | 150 | 150 | 3973 | 3973 | 133 | 133 | 3305 | 3305 |

* 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.