

Fecha de Publicación: 12 de agosto de 2016

Fecha de Información: 10 de agosto 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\$1866.1 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 8.0%.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 | 474.0 | 223.2 | 62.6 | 380.0 | 83.6 | 17.0 | 77.0 |
| 15-35 | 455.5 | 605.7 | 426.8 | 182.5 | 74.9 | 169.0 | 104.0 |
| 36-60 | 20.4 | 44.4 | 26.3 | 4.2 | 18.1 | 16.1 | 0.0 |
| 61-90 | 1.1 | 10.3 | 0.0 | 0.0 | 10.3 | 1.1 | 0.0 |
| 91-180 | 3.6 | 23.1 | 0.0 | 0.0 | 23.1 | 3.6 | 0.0 |
| >180 | 110.2 | 75.6 | 0.0 | 0.0 | 75.6 | 110.2 | 0.0 |
| Total | 1064.7 | 982.3 | 515.7 | 566.7 | 285.6 | 317.0 | 181.0 |

* 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 | 9.9 % | 8.1 % | 7.1 % | 8.2 % |
| 15-35 | 8.1 % | 8.5 % | 8.0 % | 8.2 % |
| 36-60 | - | 8.5 % | 7.8 % | 8.1 % |
| 61-90 | - | 8.3 % | 7.2 % | 8.2 % |
| 91-180 | - | 7.9 % | 7.1 % | 7.8 % |
| >180 | - | 7.1 % | 6.9 % | 7.0 % |
| Total | 8.9 % | 8.2 % | 7.5 % | 8.0 % |

*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 | 8 al 12 de agosto | | | | 15 al 19 de agosto | | | | 22 al 26 de agosto | | | |
|---------------------------|-------------------|------------|-------------|-------------|--------------------|------------|-------------|-------------|--------------------|------------|-------------|-------------|
| | Delivery | | NDF | | Delivery | | NDF | | Delivery | | NDF | |
| | C | V | C | V | C | V | C | V | C | V | C | V |
| Sector Financiero** | 18 | 112 | 4466 | 4159 | 21 | 88 | 2551 | 3099 | 257 | 103 | 2253 | 2393 |
| Intragrupo y off-shore*** | 0 | 0 | 1923 | 1580 | 3 | 0 | 1704 | 777 | 0 | 115 | 1041 | 589 |
| Otros | 112 | 18 | 938 | 1549 | 85 | 21 | 683 | 1051 | 103 | 142 | 655 | 963 |
| Total | 130 | 130 | 7328 | 7288 | 109 | 109 | 4938 | 4927 | 359 | 359 | 3950 | 3945 |

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