

Fecha de Publicación: 10 de noviembre de 2016

Fecha de Información: 08 de noviembre de martes 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\$1415.1 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 5.6%.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 | 213.8 | 162.0 | 95.5 | 153.5 | 27.5 | 21.3 | 39.0 |
| 15-35 | 394.9 | 289.7 | 167.1 | 303.0 | 67.7 | 36.9 | 55.0 |
| 36-60 | 75.8 | 80.6 | 0.2 | 0.6 | 80.4 | 75.2 | 0.0 |
| 61-90 | 126.3 | 81.4 | 1.5 | 0.0 | 79.9 | 126.3 | 0.0 |
| 91-180 | 21.4 | 34.3 | 0.0 | 5.0 | 34.3 | 16.4 | 0.0 |
| >180 | 10.3 | 23.6 | 0.0 | 0.0 | 18.6 | 5.3 | 5.0 |
| Total | 842.5 | 671.6 | 264.2 | 462.1 | 308.4 | 281.4 | 99.0 |

* 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 | 6.2 % | 5.9 % | 3.4 % | 4.8 % |
| 15-35 | 6.2 % | 5.8 % | 5.8 % | 5.8 % |
| 36-60 | - | 6.0 % | 5.7 % | 5.8 % |
| 61-90 | - | 6.3 % | 5.7 % | 5.9 % |
| 91-180 | - | 5.8 % | 5.3 % | 5.6 % |
| >180 | 5.7 % | 5.7 % | 5.3 % | 5.6 % |
| Total | 6.2 % | 5.9 % | 5.3 % | 5.6 % |

*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

| Sectores | 7 al 11 de noviembre | | | | 14 al 18 de noviembre | | | | 21 al 25 de noviembre | | | |
|-----------------------------------|----------------------|------------|-------------|-------------|-----------------------|------------|-------------|-------------|-----------------------|------------|-------------|-------------|
| | Delivery | | NDF | | Delivery | | NDF | | Delivery | | NDF | |
| | C | V | C | V | C | V | C | V | C | V | C | V |
| Sector Financiero** | 37 | 83 | 2791 | 2628 | 38 | 87 | 2267 | 2201 | 47 | 106 | 1872 | 2360 |
| Intragruppo y off-shore*** | 0 | 0 | 1214 | 1028 | 0 | 0 | 1115 | 951 | 0 | 0 | 1215 | 508 |
| Otros | 83 | 37 | 755 | 1103 | 87 | 38 | 680 | 909 | 106 | 47 | 505 | 724 |
| Total | 120 | 120 | 4760 | 4760 | 124 | 124 | 4062 | 4062 | 154 | 154 | 3592 | 3592 |

* 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.