

Fecha de Publicación: 12 de enero de 2017

Fecha de Información: 10 de enero 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\$1189.3 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 6.6%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

| Rango | Sector Financiero** | | Intragrupa y Off-shore*** | | Otros Agentes | | Interbancarios |
|--------------|---------------------|--------------|---------------------------|--------------|---------------|--------------|----------------|
| | Compras | Ventas | Compras | Ventas | Compras | Ventas | |
| 3-14 | 213.7 | 277.6 | 193.5 | 55.9 | 14.1 | 87.8 | 70.0 |
| 15-35 | 351.4 | 389.2 | 185.3 | 148.5 | 49.9 | 48.9 | 154.1 |
| 36-60 | 66.0 | 10.6 | 0.0 | 55.9 | 10.6 | 10.0 | 0.0 |
| 61-90 | 12.1 | 4.0 | 0.0 | 10.0 | 3.0 | 1.1 | 1.0 |
| 91-180 | 20.0 | 40.4 | 0.0 | 0.0 | 40.4 | 20.0 | 0.0 |
| >180 | 6.9 | 27.6 | 10.0 | 0.7 | 12.6 | 1.3 | 5.0 |
| Total | 670.1 | 749.3 | 388.7 | 270.9 | 130.5 | 169.1 | 230.1 |

* 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 | 5.8 % | 6.5 % | 6.2 % | 6.2 % |
| 15-35 | 6.8 % | 7.0 % | 6.6 % | 6.8 % |
| 36-60 | - | 7.3 % | 6.2 % | 6.7 % |
| 61-90 | 6.4 % | 6.9 % | 6.3 % | 6.4 % |
| 91-180 | - | 6.4 % | 6.2 % | 6.3 % |
| >180 | 5.8 % | 5.9 % | 5.6 % | 5.9 % |
| Total | 6.5 % | 6.7 % | 6.4 % | 6.6 % |

*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

| Sector | 9 al 13 de enero | | | | 16 al 20 de enero | | | | 23 al 27 de enero | | | |
|----------------------------------|------------------|------------|-------------|-------------|-------------------|------------|-------------|-------------|-------------------|------------|-------------|-------------|
| | Delivery | | NDF | | Delivery | | NDF | | Delivery | | NDF | |
| | C | V | C | V | C | V | C | V | C | V | C | V |
| Sector Financiero** | 11 | 112 | 3325 | 3180 | 15 | 117 | 2302 | 2103 | 16 | 142 | 2093 | 1940 |
| Intragrupa y off-shore*** | 0 | 0 | 1442 | 1277 | 0 | 0 | 926 | 829 | 0 | 0 | 926 | 670 |
| Otros | 112 | 11 | 752 | 1062 | 117 | 15 | 617 | 912 | 142 | 16 | 660 | 1068 |
| Total | 123 | 123 | 5519 | 5519 | 132 | 132 | 3844 | 3844 | 157 | 157 | 3678 | 3678 |

* 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.