

Fecha de Publicación: 25 de enero de 2017

Fecha de Información: 23 de enero de lunes 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\$972.5 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 6.5%.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 | 98.2 | 118.0 | 79.5 | 75.3 | 38.5 | 22.9 | 0.0 |
| 15-35 | 238.2 | 161.9 | 87.5 | 108.0 | 60.4 | 116.2 | 14.0 |
| 36-60 | 105.4 | 97.7 | 5.0 | 0.0 | 92.7 | 105.4 | 0.0 |
| 61-90 | 9.9 | 33.2 | 2.0 | 0.0 | 31.1 | 9.9 | 0.0 |
| 91-180 | 33.4 | 63.0 | 0.0 | 30.0 | 63.0 | 3.4 | 0.0 |
| >180 | 15.4 | 22.2 | 0.0 | 0.0 | 12.2 | 5.4 | 10.0 |
| Total | 500.5 | 496.0 | 174.0 | 213.3 | 297.9 | 263.2 | 24.0 |

* 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 | - | 6.8 % | 6.0 % | 6.5 % |
| 15-35 | 6.6 % | 7.1 % | 6.3 % | 6.6 % |
| 36-60 | - | 6.5 % | 6.3 % | 6.4 % |
| 61-90 | - | 6.6 % | 6.2 % | 6.5 % |
| 91-180 | - | 6.5 % | 5.9 % | 6.2 % |
| >180 | 5.3 % | 6.1 % | 5.2 % | 5.7 % |
| Total | 6.1 % | 6.8 % | 6.2 % | 6.5 % |

*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 | 23 al 27 de enero | | | | 30 de ene. al 3 de febrero | | | | 6 al 10 de febrero | | | |
|-----------------------------------|-------------------|------------|-------------|-------------|----------------------------|-----------|-------------|-------------|--------------------|-----------|-------------|-------------|
| | Delivery | | NDF | | Delivery | | NDF | | Delivery | | NDF | |
| | C | V | C | V | C | V | C | V | C | V | C | V |
| Sector Financiero** | 19 | 171 | 2563 | 2602 | 8 | 89 | 2673 | 2498 | 6 | 78 | 2005 | 1954 |
| Intragruppo y off-shore*** | 0 | 0 | 1241 | 834 | 0 | 0 | 858 | 853 | 0 | 0 | 799 | 715 |
| Otros | 171 | 19 | 816 | 1185 | 89 | 8 | 773 | 954 | 78 | 6 | 704 | 825 |
| Total | 190 | 190 | 4620 | 4620 | 98 | 98 | 4305 | 4305 | 83 | 83 | 3508 | 3493 |

* 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.