

Fecha de Publicación: 12 de septiembre de 2016

Fecha de Información: 08 de septiembre de jueves 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\$1770.6 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 7.6%.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 | 470.8 | 469.0 | 129.3 | 202.0 | 155.8 | 84.8 | 184.0 |
| 15-35 | 529.0 | 406.7 | 248.0 | 238.5 | 85.7 | 217.5 | 73.0 |
| 36-60 | 12.2 | 17.5 | 0.0 | 0.0 | 17.5 | 12.2 | 0.0 |
| 61-90 | 11.9 | 29.9 | 0.0 | 10.0 | 29.9 | 1.9 | 0.0 |
| 91-180 | 6.6 | 30.1 | 0.0 | 5.0 | 30.1 | 1.6 | 0.0 |
| >180 | 7.7 | 36.3 | 20.0 | 7.0 | 16.3 | 0.7 | 0.0 |
| Total | 1038.1 | 989.5 | 397.3 | 462.5 | 335.3 | 318.6 | 257.0 |

* 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 | 7.6 % | 7.9 % | 7.5 % | 7.7 % |
| 15-35 | 7.6 % | 7.7 % | 7.4 % | 7.6 % |
| 36-60 | - | 8.0 % | 7.5 % | 7.8 % |
| 61-90 | - | 7.5 % | 6.3 % | 7.4 % |
| 91-180 | - | 7.0 % | 6.7 % | 7.0 % |
| >180 | - | 6.7 % | 6.3 % | 6.7 % |
| Total | 7.6 % | 7.7 % | 7.5 % | 7.6 % |

*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 | 5 al 9 de septiembre | | | | 12 al 16 de septiembre | | | | 19 al 23 de septiembre | | | |
|-----------------------------------|----------------------|------------|-------------|-------------|------------------------|------------|-------------|-------------|------------------------|------------|-------------|-------------|
| | Delivery | | NDF | | Delivery | | NDF | | Delivery | | NDF | |
| | C | V | C | V | C | V | C | V | C | V | C | V |
| Sector Financiero** | 54 | 66 | 3888 | 3382 | 21 | 149 | 3966 | 3361 | 21 | 126 | 3560 | 2995 |
| Intragruppo y off-shore*** | 0 | 0 | 1679 | 1940 | 0 | 0 | 1388 | 1321 | 0 | 0 | 1608 | 1544 |
| Otros | 66 | 54 | 798 | 1044 | 149 | 21 | 1232 | 1903 | 126 | 20 | 618 | 1247 |
| Total | 120 | 120 | 6366 | 6366 | 170 | 170 | 6585 | 6585 | 147 | 147 | 5786 | 5786 |

* 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.