

Fecha de Publicación: 16 de septiembre de 2016

Fecha de Información: 14 de septiembre 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\$2072.6 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 7.0%.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 | 383.5 | 428.8 | 213.6 | 208.8 | 83.2 | 42.7 | 132.0 |
| 15-35 | 569.2 | 538.8 | 265.3 | 131.9 | 66.5 | 230.3 | 207.0 |
| 36-60 | 37.3 | 83.1 | 80.0 | 1.1 | 3.1 | 36.2 | 0.0 |
| 61-90 | 1.5 | 8.4 | 0.0 | 0.0 | 8.4 | 1.5 | 0.0 |
| 91-180 | 131.5 | 24.4 | 0.0 | 120.0 | 14.4 | 1.5 | 10.0 |
| >180 | 107.9 | 107.1 | 0.0 | 0.0 | 107.1 | 107.9 | 0.0 |
| Total | 1230.9 | 1190.6 | 558.9 | 461.8 | 282.7 | 420.1 | 349.0 |

* 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 % | 7.6 % | 4.5 % | 6.4 % |
| 15-35 | 7.6 % | 7.6 % | 7.6 % | 7.6 % |
| 36-60 | - | 7.4 % | 7.4 % | 7.4 % |
| 61-90 | - | 7.2 % | 6.5 % | 7.1 % |
| 91-180 | 6.6 % | 6.9 % | 6.4 % | 6.5 % |
| >180 | - | 6.3 % | 6.2 % | 6.3 % |
| Total | 7.6 % | 7.4 % | 6.3 % | 7.0 % |

*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 | 12 al 16 de septiembre | | | | 19 al 23 de septiembre | | | | 26 al 30 de septiembre | | | |
|-----------------------------------|------------------------|------------|-------------|-------------|------------------------|------------|-------------|-------------|------------------------|------------|-------------|-------------|
| | Delivery | | NDF | | Delivery | | NDF | | Delivery | | NDF | |
| | C | V | C | V | C | V | C | V | C | V | C | V |
| Sector Financiero** | 23 | 139 | 4769 | 4356 | 23 | 129 | 3995 | 3782 | 17 | 143 | 2804 | 3069 |
| Intragruppo y off-shore*** | 0 | 0 | 1829 | 1730 | 0 | 0 | 2080 | 1674 | 0 | 0 | 1479 | 946 |
| Otros | 139 | 23 | 1492 | 2004 | 128 | 23 | 739 | 1357 | 143 | 17 | 851 | 1119 |
| Total | 163 | 163 | 8090 | 8090 | 152 | 152 | 6813 | 6813 | 161 | 161 | 5134 | 5134 |

* 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.