

Fecha de Publicación: 29 de noviembre de 2016

Fecha de Información: 25 de noviembre de viernes 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\$1038.7 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 7.3%.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 | 140.5 | 188.2 | 70.3 | 25.5 | 36.8 | 34.0 | 81.0 |
| 15-35 | 234.9 | 338.6 | 197.1 | 113.8 | 29.5 | 9.1 | 112.0 |
| 36-60 | 83.3 | 39.3 | 0.0 | 0.0 | 39.3 | 83.3 | 0.0 |
| 61-90 | 37.7 | 52.8 | 6.0 | 5.0 | 16.8 | 2.7 | 30.0 |
| 91-180 | 12.0 | 24.6 | 0.0 | 0.0 | 24.6 | 12.0 | 0.0 |
| >180 | 91.7 | 75.9 | 0.0 | 22.7 | 17.9 | 11.0 | 58.0 |
| Total | 600.2 | 719.5 | 273.4 | 167.0 | 165.0 | 152.2 | 281.0 |

* 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 | 8.0 % | 6.9 % | 6.4 % | 7.2 % |
| 15-35 | 7.9 % | 8.0 % | 7.7 % | 7.9 % |
| 36-60 | - | 6.9 % | 6.6 % | 6.7 % |
| 61-90 | 6.9 % | 6.8 % | 6.6 % | 6.9 % |
| 91-180 | - | 6.6 % | 5.8 % | 6.4 % |
| >180 | 5.6 % | 5.9 % | 5.6 % | 5.7 % |
| Total | 7.4 % | 7.5 % | 6.9 % | 7.3 % |

* 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: $((Tasa\ Pactada/Tasa\ de\ Contado) \wedge (360/Plazo)) - 1$. Para el cálculo de la devaluación implícita se excluyen las operaciones intragrupo.

Cuadro No. 3
Vencimientos de Forwards

| Sectores | 21 al 25 de noviembre | | | | 28 de nov. al 2 de diciembre | | | | 5 al 9 de diciembre | | | |
|----------------------------------|-----------------------|------------|-------------|-------------|------------------------------|------------|-------------|-------------|---------------------|-----------|-------------|-------------|
| | Delivery | | NDF | | Delivery | | NDF | | Delivery | | NDF | |
| | C | V | C | V | C | V | C | V | C | V | C | V |
| Sector Financiero** | 40 | 121 | 3073 | 3301 | 40 | 128 | 3111 | 3967 | 19 | 76 | 2094 | 2301 |
| Intragrupa y off-shore*** | 0 | 0 | 1712 | 1226 | 0 | 0 | 2099 | 956 | 0 | 0 | 1129 | 950 |
| Otros | 121 | 40 | 670 | 928 | 128 | 40 | 846 | 1133 | 76 | 19 | 720 | 692 |
| Total | 161 | 161 | 5455 | 5455 | 168 | 168 | 6057 | 6057 | 95 | 95 | 3943 | 3943 |

* 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.