

Fecha de Publicación: 3 de enero de 2017

Fecha de Información: 29 de diciembre 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\$935.1 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 6.2%.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 | 94.2 | 118.9 | 53.0 | 62.0 | 35.9 | 2.2 | 30.0 |
| 15-35 | 301.8 | 291.0 | 108.0 | 157.3 | 55.3 | 16.8 | 127.7 |
| 36-60 | 5.3 | 12.0 | 0.0 | 0.0 | 12.0 | 5.3 | 0.0 |
| 61-90 | 57.8 | 32.4 | 1.3 | 0.0 | 11.1 | 37.8 | 20.0 |
| 91-180 | 65.6 | 49.9 | 0.0 | 35.0 | 19.9 | 0.6 | 30.0 |
| >180 | 89.4 | 100.5 | 10.0 | 10.0 | 14.5 | 3.4 | 76.0 |
| Total | 614.0 | 604.7 | 172.3 | 264.3 | 148.8 | 66.1 | 283.7 |

* 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 intragruppo | | Total |
|--------------|--------------------|-------------------------------|--------------|--------------|
| | Compras/Ventas | Compras | Ventas | |
| 3-14 | 7.1 % | 7.2 % | 6.3 % | 6.8 % |
| 15-35 | 6.3 % | 6.8 % | 5.6 % | 6.2 % |
| 36-60 | - | 7.2 % | 5.5 % | 6.7 % |
| 61-90 | 6.7 % | 6.7 % | 6.1 % | 6.4 % |
| 91-180 | 6.2 % | 6.4 % | 6.1 % | 6.2 % |
| >180 | 5.3 % | 5.5 % | 5.4 % | 5.4 % |
| Total | 6.2 % | 6.7 % | 5.9 % | 6.2 % |

*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 intragruppo.

Cuadro No. 3
Vencimientos de Forwards

| Sectores | 26 al 30 de diciembre | | | | 2 al 6 de enero | | | | 9 al 13 de enero | | | |
|-----------------------------------|-----------------------|------------|-------------|-------------|-----------------|-----------|-------------|-------------|------------------|------------|-------------|-------------|
| | Delivery | | NDF | | Delivery | | NDF | | Delivery | | NDF | |
| | C | V | C | V | C | V | C | V | C | V | C | V |
| Sector Financiero** | 25 | 156 | 1478 | 1660 | 27 | 60 | 2275 | 2599 | 10 | 108 | 2719 | 2515 |
| Intragruppo y off-shore*** | 0 | 0 | 777 | 788 | 0 | 0 | 1173 | 789 | 0 | 0 | 1154 | 1090 |
| Otros | 156 | 25 | 466 | 274 | 60 | 27 | 518 | 542 | 108 | 10 | 667 | 935 |
| Total | 181 | 181 | 2721 | 2721 | 87 | 87 | 3966 | 3930 | 118 | 118 | 4541 | 4541 |

* 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.