

Fecha de Publicación: 15 de Noviembre de 2007
Fecha de Información: 13 de Noviembre de 2007 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\$372,1 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de 9,7%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero**		Otros Agentes sin intragrupo		Intragrupo***		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	39,4	62,4	37,4	9,4	25,0	30,0	101,8
15-35	95,5	121,9	79,9	85,5	32,0	-	207,4
36-60	2,1	0,7	0,7	2,1	-	-	2,8
61-90	25,4	4,5	4,5	25,4	-	-	30,0
91-180	1,5	18,0	6,5	1,5	11,5	-	19,5
>180	2,6	8,1	8,1	2,6	-	-	10,7
Total	166,5	215,6	137,1	126,5	68,5	30,0	372,1

* Cifras en millones de dólares

**Incluye operaciones interbancarias y con otros agentes

***Operaciones entre filiales (casas matrices y filiales)

Cuadro No. 2

Devaluación Implícita Ponderada por monto Anualizada

Rango	Sector Financiero*	Otros Agentes sin intragrupo		Total
	Compras/Ventas	Compras	Ventas	
3-14	-	25,3 %	11,4 %	22,5 %
15-35	7,7 %	8,7 %	6,6 %	7,6 %
36-60	-	5,8 %	2,4 %	3,2 %
61-90	-	6,5 %	5,5 %	5,6 %
91-180	-	6,0 %	4,5 %	5,7 %
>180	-	5,4 %	4,5 %	5,2 %
Total	7,7 %	12,8 %	6,6 %	9,7 %

*Incluye solo operaciones interbancarias

En el cuadro No. 3 se presentan los vencimientos de forwards para ésta y las próximas dos semanas.

Cuadro No. 3
Vencimientos de Forwards

Sector	12 al 16 de Noviembre				19 al 23 de Noviembre				26 al 30 de Noviembre			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	24	59	1027	1554	19	25	982	1182	16	40	696	887
Otros***	39	24	987	846	25	19	971	858	40	16	674	562
Intragrupo	21	0	485	99	0	0	119	32	0	0	96	17
Total	83	83	2499	2499	44	44	2073	2073	56	56	1466	1466

* Cifras en millones de dólares

**Incluye operaciones interbancarias y con otros agentes

***Otros agentes sin intragrupo

¹ Datos provisionales.

² La fórmula para la devaluación implícita es: $((\text{Tasa Pactada/Promedio SET FX}) \wedge (365/\text{Plazo})) - 1$. Para el cálculo de la devaluación implícita se excluyen las operaciones intragrupo