

Fecha de Publicación: 20 de Noviembre de 2007
Fecha de Información: 16 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\$492,5 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de 7,9%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero**		Otros Agentes sin intragrupo		Intragrupo***		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	134,4	128,2	94,2	134,4	34,0	-	262,6
15-35	78,6	75,4	60,4	58,6	-	5,0	139,0
36-60	0,9	0,0	0,0	0,9	-	-	0,9
61-90	5,1	80,0	75,0	5,1	5,0	-	85,1
91-180	0,9	4,0	4,0	0,9	-	-	4,9
>180	0,0	0,1	0,1	0,0	-	-	0,1
Total	219,8	287,7	233,7	199,8	39,0	5,0	492,5

* 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	-	8,1 %	12,0 %	10,4 %
15-35	7,1 %	5,5 %	3,9 %	4,9 %
36-60	-	-	4,2 %	4,2 %
61-90	-	6,3 %	4,1 %	6,2 %
91-180	-	5,7 %	4,6 %	5,5 %
>180	-	5,1 %	-	5,1 %
Total	7,1 %	6,8 %	9,3 %	7,9 %

*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

Sectores	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	24	25	1155	1380	16	41	755	997
Otros***	39	24	987	846	25	24	1042	1031	41	16	744	620
Intragrupo	21	0	485	99	0	0	245	32	0	0	136	17
Total	83	83	2499	2499	49	49	2442	2442	57	57	1634	1634

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