

Fecha de Publicación: 21 de Noviembre de 2007
Fecha de Información: 19 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\$346,9 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de 5,0%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero**		Otros Agentes sin intragrupo		Intragrupo***		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	32,9	22,0	12,0	32,9	10,0	-	54,9
15-35	170,9	106,3	96,3	152,9	-	8,0	267,2
36-60	10,4	0,1	0,1	10,4	-	-	10,4
61-90	2,4	0,0	0,0	2,4	-	-	2,4
91-180	6,5	0,1	0,1	6,5	-	-	6,6
>180	5,4	0,0	0,0	5,4	-	-	5,4
Total	228,4	128,5	108,5	210,4	10,0	8,0	346,9

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

*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	19 al 23 de Noviembre				26 al 30 de Noviembre				3 al 7 de Diciembre			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	25	25	1160	1426	18	41	780	1007	8	27	611	953
Otros***	25	25	1045	1036	41	18	753	645	27	8	633	460
Intragrupo	0	0	289	32	0	0	136	17	0	0	200	31
Total	50	50	2494	2494	58	58	1669	1669	35	35	1444	1444

* 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