

Fecha de Publicación: 22 de Noviembre de 2007
Fecha de Información: 20 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\$1029,1 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de 4,1%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero**		Otros Agentes sin intragrupo		Intragrupo***		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	227,8	217,8	117,8	227,8	100,0	-	445,7
15-35	154,1	309,4	228,4	118,1	55,0	10,0	437,4
36-60	1,8	70,5	70,5	1,8	-	-	72,3
61-90	4,5	38,3	26,3	2,5	10,0	-	40,8
91-180	8,6	16,4	16,4	8,6	-	-	25,0
>180	0,8	7,1	7,1	0,8	-	-	7,9
Total	397,6	659,5	466,5	359,6	165,0	10,0	1029,1

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

*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	1183	1464	18	41	972	1183	10	27	648	956
Otros***	25	25	1083	1059	41	18	830	838	27	10	636	497
Intragrupo	0	0	289	32	0	0	236	17	0	0	200	31
Total	50	50	2555	2555	59	59	2038	2038	38	38	1484	1484

* 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