

Fecha de Publicación: 23 de Noviembre de 2007
Fecha de Información: 21 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\$761,9 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de 6,0%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero**		Otros Agentes sin intragrupo		Intragrupo***		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	110,8	123,3	32,3	50,8	56,0	25,0	199,1
15-35	146,7	263,4	173,4	132,7	80,0	4,0	400,0
36-60	40,2	52,0	50,0	38,2	-	-	90,2
61-90	4,7	41,5	41,5	4,7	-	-	46,2
91-180	2,7	13,4	13,4	2,7	-	-	16,1
>180	10,3	0,0	0,0	10,3	-	-	10,3
Total	315,3	493,6	310,6	239,3	136,0	29,0	761,9

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

*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	1183	1464	19	41	1036	1257	12	27	699	1006
Otros***	25	25	1083	1059	41	19	847	876	27	12	651	513
Intragrupo	0	0	289	32	0	0	292	42	0	0	200	31
Total	50	50	2555	2555	60	60	2175	2175	39	39	1551	1551

* 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