

Fecha de Publicación: 27 de Noviembre de 2007
Fecha de Información: 23 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\$288,9 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de 5,4%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero**		Otros Agentes sin intragrupo		Intragrupo***		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	43,0	51,8	20,8	19,0	7,0	-	70,8
15-35	81,8	62,1	44,6	64,3	-	-	126,5
36-60	7,5	0,2	0,2	7,5	-	-	7,7
61-90	10,1	38,9	30,9	2,1	-	-	41,0
91-180	23,7	0,1	0,1	23,7	-	-	23,8
>180	3,5	15,6	15,6	3,5	-	-	19,1
Total	169,7	168,7	112,2	120,2	7,0	-	288,9

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

*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	1061	1285	12	27	744	1032
Otros***	25	25	1083	1059	41	19	869	901	27	12	653	534
Intragrupo	0	0	289	32	0	0	299	42	0	0	200	31
Total	50	50	2555	2555	60	60	2228	2228	39	39	1597	1597

* 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