

Fecha de Publicación: 28 de Noviembre de 2007
Fecha de Información: 26 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\$586,9 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de 4,3%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero**		Otros Agentes sin intragrupo		Intragrupo***		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	44,4	354,7	213,7	21,4	118,0	-	376,1
15-35	84,7	43,1	28,1	66,7	-	3,0	112,8
36-60	18,8	12,5	0,5	6,8	-	-	19,3
61-90	4,6	20,3	20,3	4,6	-	-	24,8
91-180	21,4	6,0	6,0	21,4	-	-	27,4
>180	15,9	10,6	7,6	15,9	3,0	-	26,5
Total	189,7	447,2	276,2	136,7	121,0	3,0	586,9

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

*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

Sector	26 al 30 de Noviembre				3 al 7 de Diciembre				10 al 14 de Diciembre			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	19	41	1079	1364	13	28	769	1189	61	33	757	1229
Otros***	41	19	924	919	28	13	692	536	33	61	910	624
Intragrupo	0	0	322	42	0	0	295	31	0	0	216	30
Total	60	60	2325	2325	40	40	1756	1756	94	94	1883	1883

* 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