

Fecha de Publicación: 30 de Noviembre de 2007
Fecha de Información: 28 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\$709,6 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de 4,2%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero**		Otros Agentes sin intragrupo		Intragrupo***		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	175,1	178,0	161,0	168,1	10,0	-	346,1
15-35	178,9	139,9	74,9	138,9	25,0	-	278,8
36-60	14,4	11,6	11,6	14,4	-	-	26,0
61-90	25,5	13,7	8,7	20,5	-	-	34,2
91-180	6,2	5,4	5,4	6,2	-	-	11,5
>180	0,7	12,2	12,2	0,7	-	-	13,0
Total	400,8	360,8	273,8	348,8	35,0	-	709,6

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

*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	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	1117	1520	14	28	965	1395	61	33	886	1312
Otros***	41	19	971	957	28	14	866	712	33	61	987	746
Intragrupo	0	0	432	42	0	0	307	31	0	0	216	30
Total	60	60	2519	2519	42	42	2138	2138	95	95	2088	2088

* 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