

Fecha de Publicación: 3 de Diciembre de 2007
Fecha de Información: 29 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\$511,4 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de 4,5%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero**		Otros Agentes sin intragrupo		Intragrupo***		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	141,1	46,2	22,2	79,1	12,0	50,0	175,4
15-35	78,8	157,2	106,2	38,8	16,0	5,0	201,0
36-60	59,3	2,7	2,7	59,3	-	-	62,0
61-90	1,1	54,3	4,3	1,1	50,0	-	55,3
91-180	2,6	14,1	14,1	2,6	-	-	16,7
>180	1,0	0,0	0,0	1,0	-	-	1,0
Total	283,8	274,6	149,6	181,8	78,0	55,0	511,4

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

*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**	17	42	1121	1520	14	27	1001	1403	63	34	993	1352
Otros***	42	17	971	961	27	14	874	748	34	63	1002	786
Intragrupo	0	0	432	42	0	0	307	31	0	0	228	85
Total	59	59	2523	2523	41	41	2181	2181	97	97	2223	2223

* 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