

Fecha de Publicación: 4 de Diciembre de 2007
Fecha de Información: 30 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\$656,6 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de 4,9%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero**		Otros Agentes sin intragrupo		Intragrupo***		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	151,0	156,5	33,5	92,0	123,0	59,0	307,5
15-35	113,8	197,1	127,1	92,8	59,0	10,0	299,9
36-60	15,8	4,4	4,4	15,8	-	-	20,2
61-90	5,6	3,0	3,0	5,6	-	-	8,6
91-180	4,9	15,1	15,1	4,9	-	-	20,0
>180	0,3	0,0	0,0	0,3	-	-	0,3
Total	291,4	376,1	183,1	211,4	182,0	69,0	656,6

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

*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**	18	41	1121	1520	25	28	1098	1534	64	34	1036	1377
Otros***	41	18	971	961	28	25	882	786	34	64	1027	829
Intragrupo	0	0	432	42	0	0	430	90	0	0	228	85
Total	59	59	2523	2523	53	53	2410	2410	97	97	2291	2291

* 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: ((Tasa Pactada/Promedio SET FX) ^ (365/Plazo)) - 1. Para el cálculo de la devaluación implícita se excluyen las operaciones intragrupo