

Fecha de Publicación: 5 de Diciembre de 2007
Fecha de Información: 03 de Diciembre 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\$598,6 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de 7,0%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero**		Otros Agentes sin intragrupo		Intragrupo***		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	41,8	83,5	40,5	26,8	28,0	-	110,3
15-35	178,5	138,9	118,9	153,5	-	5,0	297,4
36-60	15,1	127,0	127,0	15,1	-	-	142,1
61-90	12,7	30,2	30,2	12,7	-	-	42,9
91-180	0,5	4,6	4,6	0,5	-	-	5,1
>180	0,8	0,0	0,0	0,8	-	-	0,9
Total	249,3	384,2	321,2	209,3	28,0	5,0	598,6

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

*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	3 al 7 de Diciembre				10 al 14 de Diciembre				17 al 21 de Diciembre			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	26	23	1107	1556	62	34	1068	1439	116	37	893	1350
Otros***	23	26	891	795	34	62	1059	846	37	116	956	683
Intragrupo	0	0	443	90	0	0	243	85	0	0	262	77
Total	49	49	2440	2440	96	96	2370	2370	153	153	2110	2110

* 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: $((\text{Tasa Pactada/Promedio SET FX}) \wedge (365/\text{Plazo})) - 1$. Para el cálculo de la devaluación implícita se excluyen las operaciones intragrupo