

Fecha de Publicación: 6 de Diciembre de 2007
Fecha de Información: 04 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\$487,1 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de 5,6%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero**		Otros Agentes sin intragrupo		Intragrupo***		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	93,0	119,1	49,1	93,0	70,0	-	212,1
15-35	32,9	102,5	74,0	27,9	23,5	-	130,4
36-60	9,5	28,5	26,5	7,5	-	-	35,9
61-90	15,5	0,3	0,3	15,5	-	-	15,7
91-180	1,4	70,9	70,9	1,4	-	-	72,3
>180	1,0	19,5	19,5	1,0	-	-	20,6
Total	153,3	340,8	240,3	146,3	93,5	-	487,1

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

*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**	27	23	1113	1632	63	34	1083	1482	116	37	965	1356
Otros***	23	27	897	801	34	62	1102	861	37	116	962	755
Intragrupo	0	0	513	90	0	0	243	85	0	0	262	77
Total	51	51	2523	2523	97	97	2428	2428	153	153	2189	2189

* 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