

Fecha de Publicación: 07 de Diciembre de 2007
Fecha de Información: 05 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\$669,0 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de 9,8%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero**		Otros Agentes sin intragrupo		Intragrupo***		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	170,9	282,8	74,8	112,9	150,0	-	395,7
15-35	179,1	110,7	44,7	116,1	3,0	-	226,8
36-60	4,2	3,4	3,4	4,2	-	-	7,6
61-90	2,6	8,7	8,7	2,6	-	-	11,4
91-180	2,9	8,2	8,2	2,9	-	-	11,1
>180	1,4	15,1	15,0	1,4	-	-	16,4
Total	361,1	429,0	154,9	240,0	153,0	-	669,0

* 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	6,1 %	18,8 %	12,9 %	13,1 %
15-35	5,9 %	11,7 %	5,8 %	7,0 %
36-60	-	7,6 %	5,5 %	6,4 %
61-90	-	6,1 %	5,3 %	5,9 %
91-180	-	5,2 %	4,4 %	5,0 %
>180	3,9 %	5,1 %	4,4 %	5,0 %
Total	6,0 %	13,8 %	9,1 %	9,8 %

*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	21	1112	1633	63	35	1183	1681	116	37	1046	1453
Otros***	21	27	898	800	35	63	1148	957	37	116	995	773
Intragrupo	0	0	513	90	0	0	393	85	0	0	262	77
Total	49	49	2524	2524	98	98	2723	2723	153	153	2302	2302

* 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