

Fecha de Publicación: 10 de Diciembre de 2007
Fecha de Información: 06 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\$745,7 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de 5,7%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero**		Otros Agentes sin intragrupo		Intragrupo***		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	133,4	216,5	63,5	103,4	128,0	5,0	324,9
15-35	95,7	260,6	199,6	76,7	52,0	10,0	347,3
36-60	17,2	23,0	23,0	17,2	-	-	40,2
61-90	0,5	7,3	7,3	0,5	-	-	7,8
91-180	13,4	5,9	5,9	13,4	-	-	19,2
>180	0,3	6,0	6,0	0,3	-	-	6,3
Total	260,5	519,2	305,2	211,5	180,0	15,0	745,7

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

*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**	28	21	1112	1633	63	36	1274	1875	131	38	1106	1479
Otros***	21	28	898	800	36	63	1208	1048	38	131	996	803
Intragrupo	0	0	513	90	0	0	526	85	0	0	262	82
Total	49	49	2524	2524	99	99	3009	3009	169	169	2364	2364

* 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