

Fecha de Publicación: 11 de Diciembre de 2007
Fecha de Información: 07 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\$370,5 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de 5,1%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero**		Otros Agentes sin intragrupo		Intragrupo***		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	38,3	144,8	48,8	34,3	92,0	-	179,1
15-35	115,8	67,6	45,6	100,8	7,0	-	168,4
36-60	6,7	5,4	1,4	2,7	-	-	8,1
61-90	0,1	1,1	1,1	0,1	-	-	1,2
91-180	7,9	4,3	4,3	7,9	-	-	12,2
>180	0,0	1,7	1,7	0,0	-	-	1,7
Total	168,8	224,8	102,8	145,8	99,0	-	370,5

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

*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	1634	64	34	1298	1999	131	38	1121	1503
Otros***	21	28	899	800	34	64	1240	1072	38	131	1016	813
Intragrupo	0	0	513	90	0	0	618	85	0	0	262	82
Total	49	49	2524	2524	97	97	3156	3156	169	169	2398	2398

* 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