

Fecha de Publicación: 12 de Diciembre de 2007
Fecha de Información: 10 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\$525,5 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de 5,5%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero**		Otros Agentes sin intragrupo		Intragrupo***		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	47,3	149,6	12,6	25,3	120,0	5,0	179,8
15-35	164,8	163,7	130,7	131,8	-	-	295,6
36-60	9,8	34,9	11,9	1,8	15,0	-	36,8
61-90	1,5	1,7	1,7	1,5	-	-	3,2
91-180	0,0	5,4	5,4	0,0	-	-	5,4
>180	0,3	4,4	4,4	0,3	-	-	4,7
Total	223,7	359,8	166,8	160,7	135,0	5,0	525,5

* 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	4,8 %	10,2 %	3,9 %	5,6 %
15-35	3,6 %	7,2 %	4,5 %	5,6 %
36-60	3,7 %	5,2 %	4,7 %	4,6 %
61-90	-	5,8 %	4,6 %	5,2 %
91-180	-	5,5 %	-	5,5 %
>180	-	6,1 %	4,5 %	6,0 %
Total	4,0 %	7,2 %	4,4 %	5,5 %

*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	10 al 14 de Diciembre				17 al 21 de Diciembre				24 al 28 de Diciembre			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	66	33	1312	2119	131	43	1146	1523	11	16	586	624
Otros***	33	66	1241	1081	43	131	1024	827	16	11	451	440
Intragrupo	0	0	738	90	0	0	262	82	0	0	36	8
Total	98	98	3291	3291	174	174	2432	2432	27	27	1072	1072

* 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