

Fecha de Publicación: 13 de Diciembre de 2007
Fecha de Información: 11 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\$565,9 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de 7,4%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero**		Otros Agentes sin intragrupo		Intragrupo***		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	30,8	270,9	115,9	25,8	150,0	-	296,7
15-35	86,3	133,0	101,5	77,3	22,5	-	210,3
36-60	18,8	6,0	6,0	18,8	-	-	24,9
61-90	1,9	4,5	4,5	1,9	-	-	6,4
91-180	12,7	5,7	5,7	12,7	-	-	18,4
>180	0,9	8,4	8,4	0,9	-	-	9,3
Total	151,3	428,5	242,0	137,3	172,5	-	565,9

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

*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

Sector	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	72	1328	2247	130	44	1164	1617	11	16	587	651
Otros***	72	66	1248	1097	44	130	1082	839	16	11	473	442
Intragrupo	0	0	858	90	0	0	292	82	0	0	41	8
Total	138	138	3434	3434	174	174	2538	2538	27	27	1101	1101

* 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