

Fecha de Publicación: 14 de Diciembre de 2007
Fecha de Información: 12 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\$715,3 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de 6,3%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero**		Otros Agentes sin intragrupo		Intragrupo***		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	65,7	154,5	51,5	65,7	103,0	-	220,2
15-35	245,6	259,1	190,1	190,6	14,0	-	449,7
36-60	13,9	16,7	4,7	1,9	-	-	18,6
61-90	0,8	12,9	12,9	0,8	-	-	13,7
91-180	0,2	10,8	10,8	0,2	-	-	11,0
>180	1,4	0,8	0,8	1,4	-	-	2,2
Total	327,5	454,8	270,8	260,5	117,0	-	715,3

* 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	-	-4,6 %	21,7 %	8,8 %
15-35	6,6 %	7,7 %	3,9 %	5,9 %
36-60	4,8 %	5,1 %	6,6 %	5,1 %
61-90	-	4,7 %	5,9 %	4,8 %
91-180	-	4,9 %	3,9 %	4,9 %
>180	-	5,4 %	4,9 %	5,1 %
Total	6,3 %	5,0 %	7,8 %	6,3 %

*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	72	1328	2247	108	53	1237	1761	12	17	589	663
Otros***	72	66	1248	1097	53	108	1124	912	17	12	474	444
Intragrupo	0	0	858	90	0	0	395	82	0	0	52	8
Total	138	138	3433	3433	161	161	2756	2756	28	28	1115	1115

* 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