

Fecha de Publicación: 17 de Diciembre de 2007
Fecha de Información: 13 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\$1024,1 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de 6,0%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

| Rango | Sector Financiero** | | Otros Agentes sin intragrupo | | Intragrupo*** | | Total |
|--------------|---------------------|--------------|------------------------------|--------------|---------------|-------------|---------------|
| | Compras | Ventas | Compras | Ventas | Compras | Ventas | |
| 3-14 | 101,8 | 263,0 | 27,0 | 37,9 | 215,0 | 42,9 | 343,8 |
| 15-35 | 168,3 | 517,4 | 417,6 | 124,3 | 55,9 | - | 641,7 |
| 36-60 | 17,7 | 7,1 | 0,1 | 10,7 | - | - | 17,8 |
| 61-90 | 2,4 | 2,1 | 2,1 | 2,4 | - | - | 4,4 |
| 91-180 | 2,9 | 8,7 | 8,7 | 2,9 | - | - | 11,6 |
| >180 | 3,5 | 1,3 | 1,3 | 3,5 | - | - | 4,8 |
| Total | 296,5 | 799,6 | 456,7 | 181,7 | 270,9 | 42,9 | 1024,1 |

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

*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 | 110 | 57 | 1300 | 1996 | 12 | 17 | 631 | 697 |
| Otros*** | 72 | 66 | 1248 | 1097 | 57 | 110 | 1137 | 926 | 17 | 12 | 494 | 472 |
| Intragrupo | 0 | 0 | 858 | 90 | 0 | 0 | 610 | 125 | 0 | 0 | 52 | 8 |
| Total | 138 | 138 | 3433 | 3433 | 168 | 168 | 3046 | 3046 | 29 | 29 | 1176 | 1176 |

* 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