

Fecha de Publicación: 18 de Diciembre de 2007
Fecha de Información: 14 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\$634,4 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de 4,3%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero**		Otros Agentes sin intragrupo		Intragrupo***		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	107,7	187,7	23,7	32,7	148,0	59,0	279,4
15-35	140,7	213,1	101,1	92,7	66,0	2,0	307,9
36-60	15,4	5,8	5,8	15,4	-	-	21,3
61-90	1,3	1,5	1,5	1,3	-	-	2,7
91-180	1,0	13,0	13,0	1,0	-	-	13,9
>180	8,1	1,1	1,1	8,1	-	-	9,3
Total	274,2	422,2	146,2	151,2	214,0	61,0	634,4

* 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	-16,4 %	-11,2 %	17,7 %	0,7 %
15-35	4,4 %	6,3 %	4,6 %	5,3 %
36-60	-	5,6 %	4,3 %	4,7 %
61-90	-	5,9 %	6,4 %	6,1 %
91-180	-	4,9 %	5,8 %	4,9 %
>180	-	5,4 %	5,0 %	5,0 %
Total	-1,0 %	3,3 %	7,5 %	4,3 %

*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	71	1328	2248	110	56	1412	2172	13	17	632	715
Otros***	71	66	1249	1097	56	110	1167	962	17	13	494	473
Intragrupo	0	0	858	90	0	0	740	184	0	0	70	8
Total	137	137	3435	3435	166	166	3318	3318	29	29	1196	1196

* 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