

Fecha de Publicación: 19 de Diciembre de 2007
 Fecha de Información: 17 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\$810,6 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de 6,5%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero**		Otros Agentes sin intragrupo		Intragrupo***		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	34,0	206,5	24,5	25,0	175,0	2,0	233,5
15-35	249,7	362,7	148,7	92,7	57,0	-	455,4
36-60	59,4	14,2	12,2	39,4	2,0	20,0	73,6
61-90	4,9	1,4	1,4	4,9	-	-	6,3
91-180	0,2	9,1	9,1	0,2	-	-	9,3
>180	32,5	0,0	0,0	12,5	-	20,0	32,5
Total	380,7	594,0	196,0	174,7	234,0	42,0	810,6

* 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	6,3 %	-20,2 %	40,9 %	13,0 %
15-35	5,6 %	6,5 %	5,4 %	5,9 %
36-60	-	6,6 %	5,1 %	5,5 %
61-90	-	5,7 %	5,4 %	5,5 %
91-180	-	5,9 %	4,8 %	5,9 %
>180	-	5,4 %	5,6 %	5,6 %
Total	5,6 %	3,7 %	10,4 %	6,5 %

*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

Sector	17 al 21 de Diciembre				24 al 28 de Diciembre				31 de Dic. al 4 de Enero			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	111	54	1437	2354	14	17	639	742	14	11	556	631
Otros***	54	111	1192	981	17	14	496	478	11	14	445	450
Intragrupo	0	0	890	184	0	0	95	10	0	0	90	10
Total	165	165	3519	3519	30	30	1230	1230	25	25	1091	1091

* 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: ((Tasa Pactada/Promedio SET FX) ^ (365/Plazo)) - 1. Para el cálculo de la devaluación implícita se excluyen las operaciones intragrupo