

Fecha de Publicación: 20 de Diciembre de 2007
 Fecha de Información: 18 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\$983,2 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de 9,1%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero**		Otros Agentes sin intragrupo		Intragrupo***		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	166,6	196,7	70,7	94,7	113,0	58,9	350,3
15-35	246,7	342,6	231,7	219,7	83,9	-	562,3
36-60	16,5	27,0	27,0	16,5	-	-	43,5
61-90	15,9	0,2	0,2	15,9	-	-	16,1
91-180	0,3	6,4	6,4	0,3	-	-	6,7
>180	1,2	3,1	3,1	1,2	-	-	4,3
Total	447,2	576,0	339,1	348,3	196,9	58,9	983,2

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

*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	56	1552	2536	14	17	690	756	21	9	573	631
Otros***	56	111	1261	1036	17	14	497	516	9	21	445	467
Intragrupo	0	0	1003	243	0	0	95	10	0	0	90	10
Total	167	167	3815	3815	31	31	1282	1282	30	30	1107	1107

* 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