

Fecha de Publicación: 24 de Diciembre de 2007
 Fecha de Información: 20 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\$577,4 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de 8,8%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero**		Otros Agentes sin intragrupo		Intragrupo***		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	63,0	246,3	26,3	58,0	215,0	-	304,3
15-35	100,3	141,5	107,0	96,3	30,5	-	237,8
36-60	6,8	4,0	4,0	6,8	-	-	10,8
61-90	1,3	6,8	6,8	1,3	-	-	8,1
91-180	0,0	7,0	7,0	0,0	-	-	7,0
>180	3,1	6,3	6,3	3,1	-	-	9,3
Total	174,5	411,8	157,3	165,5	245,5	-	577,4

* 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	4,9 %	9,2 %	16,0 %	13,4 %
15-35	6,5 %	8,4 %	6,2 %	7,3 %
36-60	-	6,2 %	3,1 %	4,3 %
61-90	-	7,6 %	6,1 %	7,3 %
91-180	-	5,8 %	-	5,8 %
>180	-	5,5 %	4,9 %	5,3 %
Total	5,6 %	8,2 %	9,5 %	8,8 %

*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**	109	53	1552	2534	14	19	804	1159	21	9	597	641
Otros***	53	109	1262	1037	19	14	542	614	9	21	455	491
Intragrupo	0	0	1000	243	0	0	441	15	0	0	90	10
Total	162	162	3814	3814	32	32	1787	1787	31	31	1142	1142

* 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