

Fecha de Publicación: 28 de Diciembre de 2007
 Fecha de Información: 26 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\$561,5 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de 6,7%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero**		Otros Agentes sin intragrupo		Intragrupo***		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	129,6	291,0	91,0	99,6	170,0	-	390,6
15-35	76,3	61,9	59,9	74,3	-	-	136,3
36-60	6,1	1,0	1,0	6,1	-	-	7,0
61-90	0,0	2,5	2,5	0,0	-	-	2,5
91-180	5,0	8,2	8,2	5,0	-	-	13,2
>180	0,4	11,6	11,6	0,4	-	-	11,9
Total	217,3	376,2	174,2	185,3	170,0	-	561,5

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

*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	24 al 28 de Diciembre				31 de Dic. al 4 de Enero				7 al 11 de Enero			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	13	18	835	1454	21	9	697	897	20	16	985	1228
Otros***	18	13	589	645	9	21	522	576	16	20	919	743
Intragrupo	0	0	690	15	0	0	265	10	0	0	80	12
Total	31	31	2114	2114	30	30	1483	1483	36	36	1983	1983

* 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