

Fecha de Publicación: 2 de Enero de 2008
 Fecha de Información: 27 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\$599,7 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de 8,7%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero**		Otros Agentes sin intragrupo		Intragrupo***		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	114,4	138,5	58,5	114,4	80,0	-	252,9
15-35	152,7	79,1	53,1	126,7	-	-	205,8
36-60	14,1	24,9	24,9	14,1	-	-	39,0
61-90	23,3	9,6	4,6	18,3	-	-	27,9
91-180	10,3	11,3	6,3	5,3	-	-	16,6
>180	26,0	31,5	31,5	26,0	-	-	57,5
Total	340,9	294,8	178,8	304,9	80,0	-	599,7

* 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	-	25,9 %	10,4 %	15,7 %
15-35	4,6 %	5,1 %	5,9 %	5,5 %
36-60	-	5,1 %	3,7 %	4,6 %
61-90	5,1 %	5,5 %	4,8 %	4,9 %
91-180	5,3 %	5,4 %	2,6 %	4,5 %
>180	-	5,5 %	5,1 %	5,3 %
Total	4,7 %	12,0 %	7,3 %	8,7 %

*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	16	838	1459	22	9	777	1035	32	16	1035	1229
Otros***	16	13	594	648	9	22	579	656	16	32	920	793
Intragrupo	0	0	690	15	0	0	345	10	0	0	80	12
Total	29	29	2122	2122	31	31	1700	1700	48	48	2034	2034

* 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