

Fecha de Publicación: 3 de Enero de 2008
 Fecha de Información: 28 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\$518,2 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de 4,0%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero**		Otros Agentes sin intragrupo		Intragrupo***		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	55,3	244,3	30,3	55,3	214,0	-	299,6
15-35	115,3	53,3	53,3	115,3	-	-	168,6
36-60	6,6	0,3	0,3	6,6	-	-	6,9
61-90	4,9	0,4	0,4	4,9	-	-	5,3
91-180	2,1	10,8	10,8	2,1	-	-	12,8
>180	7,1	17,9	17,9	7,1	-	-	25,0
Total	191,3	326,9	112,9	191,3	214,0	-	518,2

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

*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**	12	16	843	1459	22	11	806	1089	34	17	1059	1416
Otros***	16	12	594	653	11	22	604	685	17	34	922	817
Intragrupo	0	0	690	15	0	0	374	10	0	0	265	12
Total	29	29	2128	2128	33	33	1784	1784	50	50	2246	2246

* 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