

Fecha de Publicación: 12 de Septiembre de 2007
Fecha de Información: 10 de Septiembre 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\$465,7 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de 1,6%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero		Sector Real		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	64,0	15,0	15,0	64,0	79,0
15-35	134,8	139,2	138,2	133,8	273,0
36-60	30,4	38,5	38,5	30,4	68,8
61-90	2,2	0,3	0,3	2,2	2,6
91-180	7,2	33,5	31,3	5,0	38,5
>180	2,7	1,0	1,0	2,7	3,8
Total	241,3	227,6	224,4	238,1	465,7

* Cifras en millones de dólares

Cuadro No. 2
Devaluación Implícita Anualizada

Rango	Promedio Simple	Promedio Ponderado por Monto
3-14	0,2 %	-5,4 %
15-35	4,4 %	2,8 %
36-60	4,5 %	4,1 %
61-90	4,7 %	4,2 %
91-180	4,5 %	3,1 %
>180	4,0 %	4,2 %
Total	4,0 %	1,6 %

En el cuadro No. 3 se presentan los vencimientos de forwards para ésta y las próximas dos semanas.³

Cuadro No. 3
Vencimientos de Forwards

Sectores	10 al 14 de Septiembre				17 al 21 de Septiembre				24 al 28 de Septiembre			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Financiero	30	29	1226	1286	20	51	1011	1118	13	34	968	937
Real	29	30	1163	1104	51	20	989	882	34	13	795	826
Total	59	59	2390	2390	71	71	2000	2000	47	47	1763	1763

* Cifras en millones de dólares

¹ Datos provisionales.

² La fórmula para la devaluación implícita es: $((\text{Tasa Pactada}/\text{Promedio SET FX}) \wedge (365/\text{Plazo})) - 1$

³ A partir del 11 de septiembre se presenta la proyección de vencimientos.