

Fecha de Publicación: 20 de Septiembre de 2007
Fecha de Información: 18 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\$472,8 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de 1,1%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero		Sector Real		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	50,0	64,7	64,7	50,0	114,7
15-35	156,3	145,4	136,4	147,3	292,7
36-60	22,4	4,6	4,6	22,4	27,0
61-90	0,6	1,2	1,2	0,6	1,8
91-180	10,5	20,2	20,2	10,5	30,6
>180	3,0	3,0	3,0	3,0	6,0
Total	242,8	239,1	230,1	233,8	472,8

* Cifras en millones de dólares

Cuadro No. 2
Devaluación Implícita Anualizada

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

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	17 al 21 de Septiembre				1 al 5 de Octubre				24 al 28 de Septiembre			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Financiero	22	44	1225	1378	9	17	551	813	12	37	1145	1062
Real	44	22	1234	1081	17	9	780	517	37	12	916	1000
Total	66	66	2460	2460	26	26	1331	1331	48	48	2061	2061

* Cifras en millones de dólares

¹ Datos provisionales.

² La fórmula para la devaluación implícita es: ((Tasa Pactada/Promedio SET FX) ^ (365/Plazo)) - 1

³ A partir del 19 de septiembre se presenta la proyección de vencimientos.