

Fecha de Publicación: 2 de Octubre de 2007
Fecha de Información: 28 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\$374,1 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de -0,7%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero		Sector Real		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	59,8	80,4	72,4	51,8	132,2
15-35	119,0	49,3	49,3	119,0	168,3
36-60	11,8	1,0	1,0	11,8	12,8
61-90	2,1	0,2	0,2	2,1	2,3
91-180	22,5	33,0	33,0	22,5	55,5
>180	1,3	1,7	1,7	1,3	3,0
Total	216,5	165,7	157,6	208,4	374,1

* Cifras en millones de dólares

Cuadro No. 2
Devaluación Implícita Anualizada

Rango	Promedio Simple	Promedio Ponderado por Monto
3-14	0,5 %	-8,7 %
15-35	3,9 %	3,7 %
36-60	3,1 %	3,6 %
61-90	3,7 %	3,2 %
91-180	3,3 %	3,3 %
>180	4,3 %	4,8 %
Total	2,7 %	-0,7 %

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	24 al 28 de Septiembre				1 al 5 de Octubre				8 al 12 de Octubre			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Financiero	13	28	1392	1311	13	20	897	1101	9	44	924	1152
Real	28	13	1144	1225	20	13	1071	867	44	9	1070	842
Total	42	42	2536	2536	34	34	1968	1968	53	53	1994	1994

* 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 1 de octubre se presenta la proyección de vencimientos.