

Fecha de Publicación: 3 de Octubre de 2007
Fecha de Información: 01 de Octubre 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\$394,7 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de 5,5%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero		Sector Real		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	53,2	16,9	16,9	53,2	70,1
15-35	112,8	170,7	154,7	96,8	267,5
36-60	15,1	15,7	15,7	15,1	30,8
61-90	3,1	4,7	4,7	3,1	7,8
91-180	6,3	10,9	10,9	6,3	17,3
>180	0,0	1,3	1,3	0,0	1,3
Total	190,5	220,2	204,2	174,5	394,7

* Cifras en millones de dólares

Cuadro No. 2
Devaluación Implícita Anualizada

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

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	1 al 5 de Octubre				8 al 12 de Octubre				15 al 19 de Octubre			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Financiero	14	20	905	1115	9	44	969	1162	18	25	801	752
Real	20	14	1085	875	44	9	1081	888	25	18	722	771
Total	34	34	1990	1990	53	53	2050	2050	43	43	1523	1523

* 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 2 de octubre se presenta la proyección de vencimientos.