

Fecha de Publicación: 5 de Octubre de 2007
Fecha de Información: 03 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\$525,0 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de 2,6%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero		Sector Real		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	113,8	66,1	56,1	103,8	169,8
15-35	133,3	181,0	155,8	108,1	289,2
36-60	12,6	22,3	22,3	12,6	34,9
61-90	5,8	1,4	1,4	5,8	7,2
91-180	0,9	10,1	10,1	0,9	11,0
>180	12,9	0,0	0,0	12,9	12,9
Total	279,3	280,9	245,7	244,1	525,0

* Cifras en millones de dólares

Cuadro No. 2
Devaluación Implícita Anualizada

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

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	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	16	20	922	1131	10	44	1075	1241	19	26	851	829
Real	20	16	1101	891	44	10	1149	983	26	19	790	812
Total	36	36	2022	2022	54	54	2224	2224	45	45	1641	1641

* 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 4 de octubre se presenta la proyección de vencimientos.