

Fecha de Publicación: 8 de Octubre de 2007
Fecha de Información: 04 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\$490,8 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de 2,4%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero		Sector Real		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	92,1	77,6	58,0	72,5	150,1
15-35	123,7	201,2	193,2	115,7	316,9
36-60	1,0	2,2	2,2	1,0	3,3
61-90	7,2	1,4	1,4	7,2	8,6
91-180	0,9	3,2	3,2	0,9	4,1
>180	1,2	6,6	6,6	1,2	7,8
Total	226,2	292,2	264,6	198,6	490,8

* Cifras en millones de dólares

Cuadro No. 2
Devaluación Implícita Anualizada

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

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

Sector	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	41	1165	1289	19	22	852	867
Real	20	16	1101	892	41	10	1177	1054	22	19	827	813
Total	36	36	2023	2023	51	51	2343	2343	42	42	1680	1680

* 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 5 de octubre se presenta la proyección de vencimientos.