

Fecha de Publicación: 9 de Octubre de 2007
Fecha de Información: 05 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\$640,5 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de 1,0%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero		Sector Real		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	115,9	80,0	80,0	115,9	195,9
15-35	194,7	138,0	134,0	190,7	328,7
36-60	18,0	8,8	8,8	18,0	26,8
61-90	35,7	6,1	6,1	35,7	41,7
91-180	10,3	21,3	21,0	10,0	31,3
>180	4,6	11,4	11,4	4,6	16,0
Total	379,1	265,6	261,3	374,9	640,5

* Cifras en millones de dólares

Cuadro No. 2
Devaluación Implícita Anualizada

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

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	19	922	1133	10	42	1254	1329	20	24	880	902
Real	19	16	1103	892	42	10	1218	1143	24	20	863	840
Total	35	35	2025	2025	53	53	2472	2472	43	43	1742	1742

* 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 8 de octubre se presenta la proyección de vencimientos.