

Fecha de Publicación: 10 de Octubre de 2007
Fecha de Información: 08 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\$221,6 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de 4,1%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero		Sector Real		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	1,3	5,1	5,1	1,3	6,5
15-35	106,3	90,9	70,9	86,3	177,2
36-60	0,7	29,1	29,1	0,7	29,8
61-90	0,0	1,6	1,6	0,0	1,6
91-180	0,1	5,3	5,3	0,1	5,4
>180	0,2	1,0	1,0	0,2	1,2
Total	108,7	133,0	113,0	88,7	221,6

* Cifras en millones de dólares

Cuadro No. 2
Devaluación Implícita Anualizada

Rango	Promedio Simple	Promedio Ponderado por Monto
3-14	5,2 %	18,9 %
15-35	3,2 %	3,5 %
36-60	4,1 %	4,8 %
61-90	4,1 %	4,3 %
91-180	4,1 %	3,6 %
>180	3,6 %	4,4 %
Total	3,8 %	4,1 %

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	8 al 12 de Octubre				15 al 19 de Octubre				22 al 26 de Octubre			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Financiero	10	39	1250	1333	20	24	884	907	7	32	676	767
Real	39	10	1222	1139	24	20	868	845	32	7	709	618
Total	49	49	2472	2472	44	44	1752	1752	38	38	1385	1385

* 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 9 de octubre se presenta la proyección de vencimientos.