

Fecha de Publicación: 11 de Octubre de 2007
Fecha de Información: 09 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\$605,2 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de 3,6%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero		Sector Real		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	41,6	20,3	20,3	41,6	61,9
15-35	130,9	224,9	213,9	119,9	344,9
36-60	3,0	8,7	8,7	3,0	11,7
61-90	4,0	17,1	17,1	4,0	21,1
91-180	47,6	38,9	38,9	47,6	86,5
>180	51,7	27,4	27,4	51,7	79,1
Total	278,9	337,3	326,3	267,9	605,2

* Cifras en millones de dólares

Cuadro No. 2
Devaluación Implícita Anualizada

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

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	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	38	1262	1348	20	24	916	913	7	32	684	806
Real	38	10	1237	1151	24	20	874	877	32	7	746	624
Total	48	48	2499	2499	44	44	1790	1790	39	39	1431	1431

* 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 10 de octubre se presenta la proyección de vencimientos.