

Fecha de Publicación: 12 de Octubre de 2007
Fecha de Información: 10 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\$397,9 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de 4,8%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero		Sector Real		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	50,4	16,1	5,1	39,4	55,4
15-35	110,0	183,6	142,6	69,0	252,7
36-60	60,8	1,8	1,8	60,8	62,7
61-90	9,0	6,3	2,3	5,0	11,3
91-180	3,1	1,9	1,9	3,1	4,9
>180	5,0	6,0	6,0	5,0	11,0
Total	238,3	215,7	159,7	182,3	397,9

* Cifras en millones de dólares

Cuadro No. 2
Devaluación Implícita Anualizada

Rango	Promedio Simple	Promedio Ponderado por Monto
3-14	-0,7 %	4,2 %
15-35	4,1 %	5,5 %
36-60	3,6 %	3,3 %
61-90	3,9 %	2,6 %
91-180	4,1 %	3,7 %
>180	4,5 %	3,8 %
Total	2,8 %	4,8 %

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	8	36	1262	1350	20	24	949	926	8	32	711	809
Real	36	8	1239	1151	24	20	879	902	32	8	746	648
Total	44	44	2502	2502	44	44	1828	1828	40	40	1457	1457

* Cifras en millones de dólares

¹ Datos provisionales.

² La fórmula para la devaluación implícita es: $((\text{Tasa Pactada}/\text{Promedio SET FX}) \wedge (365/\text{Plazo})) - 1$

³ A partir del 11 de octubre se presenta la proyección de vencimientos.