

Fecha de Publicación: 13 de Octubre de 2007
 Fecha de Información: 11 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\$433,1 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de 3,5%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero		Sector Real		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	26,1	26,9	26,9	26,1	53,1
15-35	68,0	223,0	217,0	62,0	285,0
36-60	72,7	0,7	0,7	72,7	73,4
61-90	3,8	2,6	2,6	3,8	6,3
91-180	4,5	5,2	5,2	4,5	9,7
>180	0,9	4,7	4,7	0,9	5,6
Total	175,9	263,2	257,2	169,9	433,1

* Cifras en millones de dólares

Cuadro No. 2
Devaluación Implícita Anualizada

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

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	34	1262	1352	20	24	954	951	9	32	741	811
Real	34	8	1241	1151	24	20	904	907	32	9	748	678
Total	43	43	2503	2503	44	44	1858	1858	41	41	1488	1488

* 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 12 de octubre se presenta la proyección de vencimientos.