

Fecha de Publicación: 17 de Octubre de 2007
Fecha de Información: 12 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\$321,5 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de 2,8%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero		Sector Real		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	16,7	22,4	22,4	16,7	39,1
15-35	84,3	129,3	127,3	82,3	211,7
36-60	43,8	0,3	0,3	43,8	44,1
61-90	1,5	4,8	4,8	1,5	6,3
91-180	3,0	8,3	8,3	3,0	11,2
>180	1,1	7,9	7,9	1,1	9,0
Total	150,5	173,0	171,0	148,5	321,5

* Cifras en millones de dólares

Cuadro No. 2
Devaluación Implícita Anualizada

Rango	Promedio Simple	Promedio Ponderado por Monto
3-14	1,3 %	4,4 %
15-35	3,0 %	2,1 %
36-60	3,6 %	2,6 %
61-90	4,3 %	4,1 %
91-180	3,3 %	4,0 %
>180	5,8 %	10,6 %
Total	3,0 %	2,8 %

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	34	1262	1352	21	24	964	954	9	32	749	831
Real	34	8	1241	1151	24	21	907	917	32	9	768	687
Total	42	42	2503	2503	44	44	1871	1871	41	41	1517	1517

* 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 15 de octubre se presenta la proyección de vencimientos.