

Fecha de Publicación: 19 de Octubre de 2007
Fecha de Información: 17 de Octubre de 2007¹

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Según el reporte de los Intermediarios del Mercado Cambiario durante el día se pactó un total de US\$672,0 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de 1,7%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero		Sector Real		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	87,3	94,8	82,8	75,3	170,1
15-35	170,0	297,3	277,3	150,0	447,4
36-60	14,2	0,4	0,4	14,2	14,6
61-90	27,9	12,9	0,9	15,9	28,8
91-180	7,7	0,4	0,4	7,7	8,0
>180	0,1	3,0	3,0	0,1	3,2
Total	307,2	408,8	364,8	263,2	672,0

* Cifras en millones de dólares

Cuadro No. 2
Devaluación Implícita Anualizada

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

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	15 al 19 de Octubre				22 al 26 de Octubre				29 de Oct. al 2 de Noviembre			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Financiero	19	21	990	998	12	27	835	933	9	30	905	1123
Real	21	19	951	943	27	12	858	760	30	9	1025	807
Total	40	40	1941	1941	39	39	1692	1692	38	38	1930	1930

* 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 18 de octubre se presenta la proyección de vencimientos.