

Fecha de Publicación: 26 de Octubre de 2007
Fecha de Información: 24 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\$503,7 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de 5,1%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero		Sector Real		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	63,8	76,6	76,6	63,8	140,3
15-35	221,7	180,0	125,0	166,7	346,8
36-60	5,5	2,0	0,0	3,5	5,5
61-90	4,5	1,0	1,0	4,5	5,5
91-180	3,6	0,8	0,8	3,6	4,5
>180	1,2	0,0	0,0	1,2	1,2
Total	300,2	260,5	203,5	243,2	503,7

* Cifras en millones de dólares

Cuadro No. 2
Devaluación Implícita Anualizada

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

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	22 al 26 de Octubre				29 de Oct. al 2 de Noviembre				5 al 9 de Noviembre			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Financiero	12	19	992	1149	20	30	1063	1319	7	24	680	877
Real	19	12	1018	861	30	20	1201	945	24	7	839	641
Total	31	31	2010	2010	50	50	2265	2265	31	31	1519	1519

* 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 25 de octubre se presenta la proyección de vencimientos.