

Fecha de Publicación: 31 de Octubre de 2007
Fecha de Información: 29 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\$387,9 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de 4,9%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero		Sector Real		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	44,5	14,9	14,9	44,5	59,4
15-35	167,7	143,1	124,1	148,7	291,8
36-60	1,7	5,7	5,7	1,7	7,4
61-90	1,1	2,4	2,4	1,1	3,5
91-180	10,7	2,3	2,3	10,7	13,0
>180	3,0	12,7	9,7	0,0	12,7
Total	228,7	181,2	159,2	206,7	387,9

* Cifras en millones de dólares

Cuadro No. 2
Devaluación Implícita Anualizada

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

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	29 de Oct. al 2 de Noviembre				5 al 9 de Noviembre				12 al 16 de Noviembre			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Financiero	19	28	1118	1370	7	24	748	910	29	33	768	885
Real	28	19	1252	1000	24	7	872	710	33	29	814	696
Total	47	47	2370	2370	31	31	1620	1620	62	62	1582	1582

* 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 30 de octubre se presenta la proyección de vencimientos.