

Fecha de Publicación: 1 de Noviembre de 2007
Fecha de Información: 30 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\$287,5 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de 5,4%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero		Sector Real		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	48,0	25,4	25,4	48,0	73,4
15-35	121,4	86,4	70,2	105,2	191,6
36-60	7,0	1,1	1,1	7,0	8,0
61-90	0,6	0,9	0,9	0,6	1,5
91-180	4,0	4,3	4,3	4,0	8,4
>180	1,0	3,7	3,7	1,0	4,7
Total	182,0	121,7	105,5	165,8	287,5

* Cifras en millones de dólares

Cuadro No. 2
Devaluación Implícita Anualizada

Rango	Promedio Simple	Promedio Ponderado por Monto
3-14	10,2 %	8,1 %
15-35	4,2 %	4,5 %
36-60	4,4 %	3,7 %
61-90	5,1 %	4,5 %
91-180	4,2 %	4,2 %
>180	9,2 %	4,8 %
Total	5,2 %	5,4 %

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	20	25	1123	1378	5	24	794	931	29	33	778	885
Real	25	20	1260	1005	24	5	893	756	33	29	814	707
Total	45	45	2383	2383	30	30	1687	1687	62	62	1592	1592

* 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 31 de octubre se presenta la proyección de vencimientos.