

Fecha de Publicación: 6 de Noviembre de 2007
Fecha de Información: 01 de Noviembre 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\$502,6 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de 6,4%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero		Sector Real		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	37,8	74,5	74,5	37,8	112,3
15-35	148,5	270,9	224,9	102,5	373,4
36-60	6,0	0,0	0,0	6,0	6,0
61-90	4,4	0,0	0,0	4,4	4,4
91-180	4,5	1,7	1,7	4,5	6,2
>180	0,1	0,1	0,1	0,1	0,2
Total	201,4	347,2	301,2	155,4	502,6

* Cifras en millones de dólares

Cuadro No. 2
Devaluación Implícita Anualizada

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

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

Sector	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	1124	1379	5	24	830	995	31	34	795	937
Real	25	20	1261	1006	24	5	957	791	34	31	865	723
Total	45	45	2385	2385	29	29	1786	1786	64	64	1660	1660

* 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 2 de noviembre se presenta la proyección de vencimientos.