

Fecha de Publicación: 9 de Noviembre de 2007
Fecha de Información: 07 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\$283,5 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de 5,7%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero		Sector Real		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	40,4	30,3	20,3	30,4	60,7
15-35	77,5	117,6	98,6	58,5	176,1
36-60	0,3	5,0	5,0	0,3	5,3
61-90	11,1	10,3	10,3	11,1	21,4
91-180	7,6	0,6	0,6	7,6	8,2
>180	5,9	5,9	5,9	5,9	11,8
Total	142,8	169,6	140,6	113,8	283,5

* Cifras en millones de dólares

Cuadro No. 2
Devaluación Implícita Anualizada

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

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	5 al 9 de Noviembre				12 al 16 de Noviembre				19 al 23 de Noviembre			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Financiero	8	22	855	1036	39	34	847	989	12	25	854	1004
Real	22	8	997	817	34	39	907	766	25	12	912	762
Total	30	30	1852	1852	73	73	1754	1754	37	37	1766	1766

* 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 8 de noviembre se presenta la proyección de vencimientos.