

Fecha de Publicación: 13 de Noviembre de 2007
Fecha de Información: 08 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\$616,7 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de 6,6%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero		Sector Real		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	104,6	42,5	42,5	104,6	147,1
15-35	167,2	259,4	246,4	154,2	413,6
36-60	2,2	25,5	25,5	2,2	27,7
61-90	7,0	4,6	4,6	7,0	11,6
91-180	1,4	2,7	2,7	1,4	4,1
>180	0,1	12,5	12,5	0,1	12,6
Total	282,5	347,2	334,2	269,5	616,7

* Cifras en millones de dólares

Cuadro No. 2
Devaluación Implícita Anualizada

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

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	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	10	22	850	1035	42	35	880	1030	12	25	926	1020
Real	22	10	997	812	35	42	949	798	25	12	928	833
Total	32	32	1848	1848	77	77	1829	1829	37	37	1854	1854

* 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 9 de noviembre se presenta la proyección de vencimientos.