

Fecha de Publicación: 11 de Septiembre de 2007
Fecha de Información: 07 de Septiembre 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\$569,6 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de 8,2%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero		Sector Real		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	198,5	85,6	60,6	173,5	259,1
15-35	94,0	190,6	157,6	61,0	251,6
36-60	1,9	13,2	13,2	1,9	15,0
61-90	3,0	23,8	23,8	3,0	26,8
91-180	4,2	0,1	0,1	4,2	4,3
>180	10,8	2,0	2,0	10,8	12,8
Total	312,4	315,2	257,2	254,4	569,6

* Cifras en millones de dólares

Cuadro No. 2
Devaluación Implícita Anualizada

Rango	Promedio Simple	Promedio Ponderado por Monto
3-14	3,7 %	11,3 %
15-35	4,9 %	5,7 %
36-60	3,9 %	5,7 %
61-90	3,7 %	4,9 %
91-180	3,5 %	3,9 %
>180	3,4 %	3,9 %
Total	4,0 %	8,2 %

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	3 al 7 de Septiembre				10 al 14 de Septiembre				17 al 21 de Septiembre			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Financiero	18	45	784	1119	28	29	1211	1275	21	47	964	1118
Real	45	18	1057	722	29	28	1152	1088	47	21	989	835
Total	64	64	1841	1841	57	57	2363	2363	68	68	1952	1952

* Cifras en millones de dólares

¹ Datos provisionales.

² La fórmula para la devaluación implícita es: $((\text{Tasa Pactada}/\text{Promedio SET FX}) \wedge (365/\text{Plazo})) - 1$

³ A partir del 10 de septiembre se presenta la proyección de vencimientos.