

Fecha de Publicación: 13 de Septiembre de 2007
Fecha de Información: 11 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\$397,8 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de 4,0%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero		Sector Real		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	79,2	29,4	29,4	79,2	108,7
15-35	94,1	158,9	158,9	94,1	253,0
36-60	2,7	0,2	0,2	2,7	2,9
61-90	0,5	1,5	1,5	0,5	1,9
91-180	0,3	29,1	29,1	0,3	29,4
>180	1,8	0,0	0,0	1,8	1,8
Total	178,7	219,1	219,1	178,7	397,8

* Cifras en millones de dólares

Cuadro No. 2
Devaluación Implícita Anualizada

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

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	10 al 14 de Septiembre				17 al 21 de Septiembre				24 al 28 de Septiembre			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Financiero	31	37	1227	1287	21	51	1058	1135	13	35	1005	942
Real	37	31	1164	1105	51	21	1006	929	35	13	800	863
Total	67	67	2392	2392	72	72	2065	2065	48	48	1805	1805

* 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 12 de septiembre se presenta la proyección de vencimientos.