

Fecha de Publicación: 14 de Septiembre de 2007
Fecha de Información: 12 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\$330,0 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de 4,4%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero		Sector Real		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	45,6	21,5	21,5	45,6	67,1
15-35	106,3	82,4	75,4	99,3	181,7
36-60	3,4	2,0	2,0	3,4	5,4
61-90	2,7	33,1	33,1	2,7	35,7
91-180	0,0	38,1	38,0	0,0	38,1
>180	0,0	2,0	2,0	0,0	2,0
Total	158,0	179,0	171,9	151,0	330,0

* Cifras en millones de dólares

Cuadro No. 2
Devaluación Implícita Anualizada

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

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

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	50	1088	1155	13	35	1024	948
Real	37	31	1164	1105	50	21	1026	959	35	13	805	881
Total	68	68	2392	2392	71	71	2114	2114	48	48	1829	1829

* 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 13 de septiembre se presenta la proyección de vencimientos.