

Fecha de Publicación: 17 de Septiembre de 2007
 Fecha de Información: 13 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\$538,3 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de 5,8%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

| Rango | Sector Financiero | | Sector Real | | Total |
|--------------|-------------------|--------------|--------------|--------------|--------------|
| | Compras | Ventas | Compras | Ventas | |
| 3-14 | 29,9 | 115,0 | 115,0 | 29,9 | 144,8 |
| 15-35 | 160,5 | 182,0 | 178,0 | 156,5 | 338,5 |
| 36-60 | 0,0 | 0,9 | 0,9 | 0,0 | 0,9 |
| 61-90 | 2,5 | 12,8 | 12,8 | 2,5 | 15,3 |
| 91-180 | 6,4 | 25,5 | 25,5 | 6,4 | 31,9 |
| >180 | 0,0 | 6,8 | 6,8 | 0,0 | 6,8 |
| Total | 199,3 | 343,0 | 339,0 | 195,3 | 538,3 |

* Cifras en millones de dólares

Cuadro No. 2
Devaluación Implícita Anualizada

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

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 | 32 | 37 | 1218 | 1287 | 21 | 50 | 1114 | 1233 | 13 | 36 | 1037 | 1004 |
| Real | 37 | 32 | 1165 | 1095 | 50 | 21 | 1104 | 985 | 36 | 13 | 862 | 895 |
| Total | 68 | 68 | 2382 | 2382 | 72 | 72 | 2218 | 2218 | 48 | 48 | 1899 | 1899 |

* 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 14 de septiembre se presenta la proyección de vencimientos.