

Fecha de Publicación: 18 de Septiembre de 2007
Fecha de Información: 14 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\$411,6 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	54,9	87,8	72,8	39,9	127,7
15-35	152,2	51,7	35,7	136,2	187,9
36-60	6,1	4,6	4,6	6,1	10,8
61-90	17,0	11,8	11,8	17,0	28,9
91-180	5,8	45,8	45,8	5,7	51,6
>180	2,3	2,5	2,5	2,3	4,8
Total	238,3	204,3	173,3	207,3	411,6

* Cifras en millones de dólares

Cuadro No. 2
Devaluación Implícita Anualizada

Rango	Promedio Simple	Promedio Ponderado por Monto
3-14	2,2 %	4,5 %
15-35	5,4 %	3,7 %
36-60	5,6 %	5,2 %
61-90	3,4 %	3,6 %
91-180	3,9 %	3,6 %
>180	5,1 %	5,3 %
Total	4,1 %	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	32	34	1217	1282	22	50	1155	1323	12	36	1063	1017
Real	34	32	1160	1095	50	22	1179	1011	36	12	874	920
Total	66	66	2377	2377	72	72	2335	2335	48	48	1937	1937

* 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 17 de septiembre se presenta la proyección de vencimientos.