

Fecha de Publicación: 21 de Septiembre de 2007
Fecha de Información: 19 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\$714,9 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de 2,8%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero		Sector Real		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	94,0	84,4	84,4	94,0	178,5
15-35	185,8	275,9	272,9	182,8	458,8
36-60	12,3	5,8	5,8	12,3	18,1
61-90	5,5	10,7	10,7	5,5	16,2
91-180	3,4	31,1	31,1	3,4	34,5
>180	2,3	6,5	6,5	2,3	8,8
Total	303,4	414,5	411,5	300,4	714,9

* Cifras en millones de dólares

Cuadro No. 2
Devaluación Implícita Anualizada

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

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	17 al 21 de Septiembre				1 al 5 de Octubre				24 al 28 de Septiembre			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Financiero	23	46	1225	1377	8	19	634	853	12	38	1214	1116
Real	46	23	1233	1081	19	8	819	601	38	12	971	1069
Total	69	69	2458	2458	27	27	1453	1453	50	50	2185	2185

* 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 20 de septiembre se presenta la proyección de vencimientos.