

Fecha de Publicación: 25 de Septiembre de 2007
Fecha de Información: 21 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\$424,7 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de 2,4%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero		Sector Real		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	74,7	59,2	59,2	74,7	133,9
15-35	71,6	96,0	87,0	62,6	158,7
36-60	1,1	7,1	7,1	1,1	8,3
61-90	69,4	8,5	8,5	69,4	78,0
91-180	26,3	9,9	9,9	26,3	36,3
>180	6,2	3,4	3,4	6,2	9,7
Total	249,4	184,3	175,3	240,4	424,7

* Cifras en millones de dólares

Cuadro No. 2
Devaluación Implícita Anualizada

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

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	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	45	1229	1379	8	19	687	901	14	39	1323	1207
Real	45	23	1235	1084	19	8	860	647	39	14	1061	1177
Total	68	68	2464	2464	27	27	1547	1547	53	53	2384	2384

* 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 24 de septiembre se presenta la proyección de vencimientos.