

Fecha de Publicación: 26 de Septiembre de 2007
Fecha de Información: 25 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\$781,4 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de 2,7%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero		Sector Real		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	46,1	118,1	118,1	46,1	164,2
15-35	145,4	383,4	380,2	142,2	525,6
36-60	17,2	21,2	21,2	17,2	38,4
61-90	15,1	1,6	1,6	15,1	16,7
91-180	1,5	3,2	3,2	1,5	4,8
>180	26,1	5,6	5,6	26,1	31,7
Total	251,5	533,1	529,9	248,3	781,4

* Cifras en millones de dólares

Cuadro No. 2
Devaluación Implícita Anualizada

Rango	Promedio Simple	Promedio Ponderado por Monto
3-14	10,4 %	9,8 %
15-35	2,2 %	0,7 %
36-60	1,7 %	0,8 %
61-90	3,3 %	1,1 %
91-180	2,8 %	2,9 %
>180	3,4 %	2,7 %
Total	4,5 %	2,7 %

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	24 al 28 de Septiembre				1 al 5 de Octubre				8 al 12 de Octubre			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Financiero	12	33	1382	1282	8	19	748	999	8	44	812	1079
Real	33	12	1125	1225	19	8	959	708	44	8	1006	738
Total	45	45	2507	2507	27	27	1707	1707	52	52	1817	1817

* 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 26 de septiembre se presenta la proyección de vencimientos.