

Fecha de Publicación: 28 de Septiembre de 2007
Fecha de Información: 26 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\$719,6 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de -0,6%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero		Sector Real		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	121,8	34,0	34,0	121,8	155,8
15-35	227,7	245,7	230,7	212,7	458,4
36-60	8,1	6,6	6,6	8,1	14,7
61-90	0,0	5,4	5,4	0,0	5,4
91-180	8,9	17,5	17,5	8,9	26,4
>180	29,5	29,5	29,5	29,5	59,0
Total	396,0	338,6	323,6	381,0	719,6

* Cifras en millones de dólares

Cuadro No. 2
Devaluación Implícita Anualizada

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

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	13	30	1382	1285	7	20	845	1030	8	44	885	1117
Real	30	13	1128	1224	20	7	990	805	44	8	1043	812
Total	43	43	2510	2510	27	27	1835	1835	52	52	1928	1928

* 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 27 de septiembre se presenta la proyección de vencimientos.