

Fecha de Publicación: 01 de Octubre de 2007
Fecha de Información: 27 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\$334,8 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de 2,2%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero		Sector Real		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	51,7	34,4	34,4	51,7	86,1
15-35	78,4	99,5	84,5	63,4	162,9
36-60	2,2	8,4	8,4	2,2	10,6
61-90	6,5	12,5	6,5	0,5	13,0
91-180	45,0	11,9	11,9	45,0	56,9
>180	3,0	2,3	2,3	3,0	5,3
Total	186,8	169,0	148,0	165,8	334,8

* Cifras en millones de dólares

Cuadro No. 2
Devaluación Implícita Anualizada

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

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	29	1382	1285	11	20	870	1063	9	44	916	1133
Real	29	13	1128	1225	20	11	1022	829	44	9	1059	842
Total	43	43	2510	2510	31	31	1892	1892	53	53	1975	1975

* 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 28 de septiembre se presenta la proyección de vencimientos.