

Fecha de Publicación: 29 de Octubre de 2007
Fecha de Información: 25 de Octubre 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\$378,2 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de 3,7%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero		Sector Real		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	31,7	25,9	25,9	31,7	57,6
15-35	96,7	201,8	197,8	92,7	294,4
36-60	2,6	2,5	2,5	2,6	5,1
61-90	0,2	1,9	1,9	0,2	2,1
91-180	12,2	6,7	6,7	12,2	18,9
>180	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
Total	143,4	238,8	234,8	139,4	378,2

* Cifras en millones de dólares

Cuadro No. 2
Devaluación Implícita Anualizada

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

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	22 al 26 de Octubre				29 de Oct. al 2 de Noviembre				5 al 9 de Noviembre			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Financiero	12	20	992	1148	20	30	1088	1345	7	24	691	878
Real	20	12	1018	861	30	20	1227	970	24	7	839	653
Total	32	32	2010	2010	50	50	2315	2315	31	31	1530	1530

* 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 octubre se presenta la proyección de vencimientos.