

Fecha de Publicación: 1 de Agosto de 2007

Fecha de Información: 30 de Julio 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\$330,1 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de 3,6%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero		Sector Real		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	37,0	46,1	46,1	37,0	83,2
15-35	65,2	97,0	91,0	59,2	156,3
36-60	14,2	28,7	28,7	14,2	42,9
61-90	0,0	0,6	0,6	0,0	0,6
91-180	23,9	13,7	7,7	17,9	31,6
>180	9,0	6,6	6,6	9,0	15,6
Total	149,4	192,7	180,7	137,4	330,1

* Cifras en millones de dólares

Cuadro No. 2
Devaluación Implícita Anualizada

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

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	30 de Jul. al 3 de Agosto				6 al 10 de Agosto				13 al 17 de Agosto			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Financiero	14	59	886	761	8	25	802	719	8	35	668	655
Real	59	14	704	829	25	8	645	727	35	8	615	628
Total	73	73	1590	1590	33	33	1447	1447	43	43	1283	1283

* 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 31 de julio se presenta la proyección de vencimientos.