

Fecha de Publicación: 2 de Agosto de 2007

Fecha de Información: 31 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\$437,6 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de 4,2%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero		Sector Real		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	40,0	72,5	47,5	15,0	87,4
15-35	163,0	140,8	115,8	138,0	278,8
36-60	7,5	14,8	14,8	7,5	22,2
61-90	0,0	2,4	2,4	0,0	2,4
91-180	39,2	19,4	7,4	27,2	46,6
>180	0,0	0,1	0,1	0,0	0,1
Total	249,6	250,0	188,0	187,6	437,6

* Cifras en millones de dólares

Cuadro No. 2
Devaluación Implícita Anualizada

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

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

Sector	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	11	57	883	777	10	25	822	758	8	35	717	711
Real	57	11	720	826	25	9	668	733	35	8	646	651
Total	68	68	1603	1603	35	35	1491	1491	43	43	1363	1363

* 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 1 de agosto se presenta la proyección de vencimientos.