

Fecha de Publicación: 2 de Agosto de 2007
 Fecha de Información: 01 de Agosto 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\$410,2 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de 3,4%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero		Sector Real		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	13,1	48,4	48,4	13,1	61,4
15-35	121,8	179,0	179,0	121,8	300,8
36-60	13,3	0,0	0,0	13,3	13,3
61-90	0,3	13,3	13,3	0,3	13,6
91-180	17,0	4,1	4,1	17,0	21,0
>180	0,0	0,1	0,1	0,0	0,1
Total	165,4	244,8	244,8	165,4	410,2

* Cifras en millones de dólares

Cuadro No. 2
Devaluación Implícita Anualizada

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

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	8	56	885	778	9	25	835	803	8	35	721	726
Real	56	8	721	828	25	9	714	745	35	8	660	655
Total	63	63	1606	1606	34	34	1548	1548	43	43	1381	1381

* 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 2 de agosto se presenta la proyección de vencimientos.