

Fecha de Publicación: 8 de Agosto de 2007
 Fecha de Información: 03 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\$348,3 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de 3,2%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero		Sector Real		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	77,1	67,4	57,4	67,1	134,5
15-35	45,9	118,9	112,9	39,9	158,8
36-60	4,2	0,1	0,1	4,2	4,3
61-90	15,0	12,0	12,0	15,0	27,0
91-180	2,3	20,4	20,4	2,3	22,7
>180	0,1	0,9	0,9	0,1	0,9
Total	144,6	219,7	203,7	128,6	348,3

* Cifras en millones de dólares

Cuadro No. 2
Devaluación Implícita Anualizada

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

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	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	23	885	811	9	25	857	861	11	35	826	854
Real	23	8	754	828	25	9	767	763	35	11	768	740
Total	31	31	1639	1639	34	34	1624	1624	45	45	1594	1594

* 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 6 de agosto se presenta la proyección de vencimientos.