

Fecha de Publicación: 9 de Agosto de 2007
 Fecha de Información: 06 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\$359,9 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de 2,4%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero		Sector Real		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	33,9	73,5	73,5	33,9	107,4
15-35	99,5	131,4	129,4	97,5	228,9
36-60	4,0	0,0	0,0	4,0	4,0
61-90	0,0	0,6	0,6	0,0	0,6
91-180	9,4	8,9	0,9	1,4	10,3
>180	8,1	0,6	0,6	8,1	8,7
Total	154,9	215,0	205,0	144,9	359,9

* Cifras en millones de dólares

Cuadro No. 2
Devaluación Implícita Anualizada

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

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	6 al 10 de Agosto				13 al 17 de Agosto				20 al 24 de Agosto			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Financiero	9	24	860	893	11	36	857	900	48	14	908	1210
Real	24	8	798	765	36	11	814	772	14	48	1081	778
Total	33	33	1658	1658	47	47	1672	1672	62	62	1988	1988

* 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 7 de agosto se presenta la proyección de vencimientos.