

Fecha de Publicación: 10 de Agosto de 2007
 Fecha de Información: 08 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\$373,0 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de 3,9%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero		Sector Real		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	68,7	26,2	26,2	68,7	94,9
15-35	105,9	151,2	131,2	85,9	237,1
36-60	27,4	0,2	0,2	27,4	27,6
61-90	0,4	0,0	0,0	0,4	0,4
91-180	0,7	3,3	3,3	0,7	4,0
>180	0,1	8,9	8,9	0,1	9,0
Total	203,2	189,8	169,8	183,2	373,0

* Cifras en millones de dólares

Cuadro No. 2
Devaluación Implícita Anualizada

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

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	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	7	24	862	893	11	41	925	913	48	14	913	1218
Real	24	6	798	768	41	11	828	840	14	48	1089	784
Total	31	31	1660	1660	52	52	1753	1753	62	62	2002	2002

* 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 9 de agosto se presenta la proyección de vencimientos.