

Fecha de Publicación: 13 de Agosto de 2007
 Fecha de Información: 09 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\$696,2 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de 5,2%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero		Sector Real		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	127,8	64,8	44,8	107,8	172,5
15-35	144,4	282,0	269,0	131,4	413,4
36-60	2,7	10,0	10,0	2,7	12,7
61-90	1,3	0,2	0,2	1,3	1,5
91-180	11,5	28,7	28,7	11,5	40,1
>180	5,7	50,4	50,4	5,7	56,1
Total	293,2	436,0	403,0	260,2	696,2

* Cifras en millones de dólares

Cuadro No. 2
Devaluación Implícita Anualizada

Rango	Promedio Simple	Promedio Ponderado por Monto
3-14	4,9 %	7,0 %
15-35	4,2 %	4,7 %
36-60	3,2 %	4,8 %
61-90	3,5 %	3,4 %
91-180	4,1 %	4,3 %
>180	4,4 %	4,6 %
Total	4,4 %	5,2 %

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	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	16	41	1025	974	48	14	938	1226
Real	24	6	798	768	41	16	869	919	14	48	1097	808
Total	31	31	1660	1660	57	57	1893	1893	62	62	2035	2035

* 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 10 de agosto se presenta la proyección de vencimientos.