

Fecha de Publicación: 14 de Agosto de 2007
 Fecha de Información: 10 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\$680,7 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de 4,4%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero		Sector Real		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	166,9	41,3	41,3	166,9	208,2
15-35	157,8	221,1	200,1	136,8	357,9
36-60	21,1	37,0	25,0	9,1	46,1
61-90	13,1	34,7	34,7	13,1	47,8
91-180	12,5	1,9	1,9	12,5	14,4
>180	4,7	1,6	1,6	4,7	6,3
Total	376,1	337,6	304,6	343,1	680,7

* Cifras en millones de dólares

Cuadro No. 2
Devaluación Implícita Anualizada

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

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	7	23	862	893	17	41	1063	1010	50	15	1063	1231
Real	23	6	799	768	41	17	904	958	15	50	1102	933
Total	30	30	1661	1661	58	58	1967	1967	66	66	2165	2165

* 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 13 de agosto se presenta la proyección de vencimientos.