

Fecha de Publicación: 16 de Agosto de 2007
 Fecha de Información: 13 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\$497,2 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de 0,7%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero		Sector Real		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	142,4	33,7	33,7	142,4	176,1
15-35	87,1	207,8	197,8	77,1	284,9
36-60	5,4	0,1	0,1	5,4	5,5
61-90	8,2	8,1	8,1	8,2	16,3
91-180	12,3	1,1	1,1	12,3	13,4
>180	0,3	0,6	0,6	0,3	1,0
Total	255,7	251,5	241,5	245,7	497,2

* Cifras en millones de dólares

Cuadro No. 2
Devaluación Implícita Anualizada

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

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	13 al 17 de Agosto				20 al 24 de Agosto				27 al 31 de Agosto			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Financiero	16	41	1077	1032	49	15	1192	1242	7	19	840	1171
Real	41	16	927	972	15	49	1113	1063	19	7	1109	777
Total	57	57	2004	2004	65	65	2305	2305	26	26	1949	1949

* 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 14 de agosto se presenta la proyección de vencimientos.