

Fecha de Publicación: 18 de Agosto de 2007
 Fecha de Información: 16 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\$849,7 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de 2,8%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero		Sector Real		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	102,1	48,6	48,6	102,1	150,8
15-35	203,3	372,6	322,1	152,8	525,4
36-60	9,0	1,6	1,6	9,0	10,6
61-90	40,2	30,2	30,2	40,2	70,4
91-180	49,9	20,0	19,9	49,9	69,9
>180	21,9	0,8	0,8	21,9	22,6
Total	426,5	473,7	423,2	376,0	849,7

* Cifras en millones de dólares

Cuadro No. 2
Devaluación Implícita Anualizada

Rango	Promedio Simple	Promedio Ponderado por Monto
3-14	-15,0 %	-19,2 %
15-35	13,8 %	8,1 %
36-60	17,4 %	8,6 %
61-90	9,9 %	4,6 %
91-180	8,2 %	6,9 %
>180	4,3 %	5,3 %
Total	8,5 %	2,8 %

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	20	30	1098	1088	23	15	1428	1396	10	19	926	1245
Real	30	20	983	992	15	23	1252	1285	19	10	1183	863
Total	49	49	2080	2080	38	38	2680	2680	29	29	2109	2109

* 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 17 de agosto se presenta la proyección de vencimientos.