

Fecha de Publicación: 23 de Agosto de 2007
 Fecha de Información: 21 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\$373,8 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de 8,2%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero		Sector Real		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	44,3	2,0	2,0	44,3	46,3
15-35	111,9	158,2	123,2	76,9	235,1
36-60	37,4	2,0	2,0	37,4	39,4
61-90	15,1	9,3	9,3	15,1	24,3
91-180	21,0	0,6	0,6	21,0	21,5
>180	7,1	0,0	0,0	7,1	7,1
Total	236,8	172,0	137,0	201,8	373,8

* Cifras en millones de dólares

Cuadro No. 2
Devaluación Implícita Anualizada

Rango	Promedio Simple	Promedio Ponderado por Monto
3-14	4,0 %	12,8 %
15-35	7,0 %	8,5 %
36-60	4,6 %	5,6 %
61-90	4,3 %	5,4 %
91-180	3,1 %	4,1 %
>180	3,5 %	3,8 %
Total	4,8 %	8,2 %

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	20 al 24 de Agosto				27 al 31 de Agosto				3 al 7 de Septiembre			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Financiero	21	15	1502	1478	14	19	981	1266	16	36	590	896
Real	15	21	1330	1354	19	14	1203	919	36	16	850	544
Total	36	36	2832	2832	33	33	2184	2184	53	53	1440	1440

* 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 22 de agosto se presenta la proyección de vencimientos.