

Fecha de Publicación: 27 de Agosto de 2007
 Fecha de Información: 23 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\$618,8 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de 6,7%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero		Sector Real		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	74,9	56,2	56,2	74,9	131,1
15-35	179,6	263,3	242,3	158,6	421,9
36-60	14,4	5,0	5,0	14,4	19,4
61-90	11,2	14,5	12,5	9,2	23,7
91-180	17,2	3,7	3,7	17,2	20,9
>180	1,9	0,0	0,0	1,9	1,9
Total	299,1	342,7	319,7	276,1	618,8

* Cifras en millones de dólares

Cuadro No. 2
Devaluación Implícita Anualizada

Rango	Promedio Simple	Promedio Ponderado por Monto
3-14	10,8 %	3,8 %
15-35	6,4 %	8,0 %
36-60	3,3 %	1,6 %
61-90	3,7 %	5,3 %
91-180	3,6 %	5,2 %
>180	5,0 %	4,9 %
Total	5,3 %	6,7 %

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	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	22	12	1502	1482	15	20	1100	1372	16	36	629	903
Real	12	22	1334	1354	20	15	1310	1038	36	16	858	583
Total	34	34	2836	2836	36	36	2410	2410	53	53	1486	1486

* 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 24 de agosto se presenta la proyección de vencimientos.