

Fecha de Publicación: 28 de Agosto de 2007
 Fecha de Información: 24 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\$533,8 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de 7,8%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

| Rango | Sector Financiero | | Sector Real | | Total |
|--------------|-------------------|--------------|--------------|--------------|--------------|
| | Compras | Ventas | Compras | Ventas | |
| 3-14 | 105,9 | 75,6 | 75,6 | 105,9 | 181,4 |
| 15-35 | 110,3 | 163,3 | 157,3 | 104,3 | 267,6 |
| 36-60 | 5,6 | 5,3 | 5,3 | 5,6 | 10,8 |
| 61-90 | 10,4 | 15,9 | 15,9 | 10,4 | 26,3 |
| 91-180 | 27,1 | 17,7 | 17,7 | 27,1 | 44,8 |
| >180 | 0,6 | 2,2 | 2,2 | 0,6 | 2,8 |
| Total | 259,9 | 279,9 | 273,9 | 253,9 | 533,8 |

* Cifras en millones de dólares

Cuadro No. 2
Devaluación Implícita Anualizada

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

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 | 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 | 21 | 1199 | 1425 | 17 | 37 | 636 | 926 |
| Real | 12 | 22 | 1334 | 1354 | 21 | 15 | 1362 | 1136 | 37 | 17 | 880 | 590 |
| Total | 34 | 34 | 2836 | 2836 | 36 | 36 | 2561 | 2561 | 53 | 53 | 1516 | 1516 |

* 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 27 de agosto se presenta la proyección de vencimientos.