

Fecha de Publicación: 30 de Agosto de 2007
 Fecha de Información: 28 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\$429,5 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de 9,4%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero		Sector Real		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	41,8	58,0	58,0	41,8	99,8
15-35	155,4	136,8	112,8	131,4	268,1
36-60	5,8	10,0	10,0	5,8	15,8
61-90	3,8	0,0	0,0	3,8	3,9
91-180	32,9	8,0	8,0	32,9	40,9
>180	1,0	0,0	0,0	1,0	1,0
Total	240,7	212,8	188,8	216,7	429,5

* Cifras en millones de dólares

Cuadro No. 2
Devaluación Implícita Anualizada

Rango	Promedio Simple	Promedio Ponderado por Monto
3-14	3,5 %	16,8 %
15-35	7,2 %	7,7 %
36-60	5,3 %	8,1 %
61-90	3,9 %	4,3 %
91-180	3,6 %	4,2 %
>180	3,8 %	4,0 %
Total	5,3 %	9,4 %

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	3 al 7 de Septiembre				10 al 14 de Septiembre				27 al 31 de Agosto			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Financiero	17	37	663	972	24	32	723	922	15	18	1252	1472
Real	37	17	917	607	32	24	823	624	18	15	1409	1189
Total	54	54	1580	1580	56	56	1546	1546	33	33	2661	2661

* Cifras en millones de dólares

¹ Datos provisionales.

² La fórmula para la devaluación implícita es: $((\text{Tasa Pactada}/\text{Promedio SET FX}) \wedge (365/\text{Plazo})) - 1$

³ A partir del 29 de agosto se presenta la proyección de vencimientos.