

Fecha de Publicación: 5 de Septiembre de 2007
Fecha de Información: 03 de Septiembre 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\$27,1 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de 5,0%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero		Sector Real		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	1,7	0,2	0,2	1,7	2,0
15-35	19,4	3,8	3,8	19,4	23,1
36-60	1,0	0,2	0,2	1,0	1,2
61-90	0,0	0,7	0,7	0,0	0,7
91-180	0,0	0,1	0,1	0,0	0,1
>180	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
Total	22,1	5,0	5,0	22,1	27,1

* Cifras en millones de dólares

Cuadro No. 2
Devaluación Implícita Anualizada

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

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				17 al 21 de Septiembre			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Financiero	19	47	759	1095	26	28	776	1086	20	47	870	970
Real	47	19	1040	704	28	26	984	673	47	20	874	774
Total	66	66	1799	1799	54	54	1760	1760	66	66	1744	1744

* 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 4 de septiembre se presenta la proyección de vencimientos.