

Fecha de Publicación: 6 de Septiembre de 2007
Fecha de Información: 04 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\$471,7 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de 3,5%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero		Sector Real		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	114,9	83,3	83,3	114,9	198,2
15-35	136,2	121,0	64,5	79,8	200,8
36-60	11,0	35,7	35,7	11,0	46,7
61-90	0,0	8,5	8,5	0,0	8,5
91-180	9,7	7,9	7,9	9,7	17,5
>180	0,0	0,1	0,1	0,0	0,1
Total	271,8	256,4	199,9	215,4	471,7

* Cifras en millones de dólares

Cuadro No. 2
Devaluación Implícita Anualizada

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

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	20	46	775	1111	25	28	876	1128	20	47	901	1029
Real	46	20	1056	720	28	25	1026	773	47	20	905	777
Total	66	66	1831	1831	53	53	1902	1902	67	67	1806	1806

* 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 5 de septiembre se presenta la proyección de vencimientos.