

Fecha de Publicación: 7 de Septiembre de 2007
Fecha de Información: 05 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\$449,6 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de 6,0%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero		Sector Real		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	73,7	48,4	48,4	73,7	122,2
15-35	73,6	179,0	173,5	68,1	247,1
36-60	0,5	0,0	0,0	0,5	0,5
61-90	2,8	2,6	2,6	2,8	5,4
91-180	10,8	35,6	35,6	10,8	46,4
>180	8,1	20,0	20,0	8,1	28,1
Total	169,5	285,6	280,1	164,0	449,6

* Cifras en millones de dólares

Cuadro No. 2
Devaluación Implícita Anualizada

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

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	20	45	782	1119	26	28	925	1161	21	47	919	1039
Real	45	20	1057	721	28	26	1064	827	47	21	914	794
Total	65	65	1840	1840	54	54	1988	1988	68	68	1833	1833

* 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 6 de septiembre se presenta la proyección de vencimientos.