

Fecha de Publicación: 4 de Septiembre de 2007
 Fecha de Información: 31 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\$415,4 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de 5,3%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero		Sector Real		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	28,7	86,0	86,0	28,7	114,7
15-35	120,1	158,4	136,4	98,1	256,5
36-60	3,1	1,2	1,2	3,1	4,3
61-90	23,9	7,6	2,6	18,9	26,4
91-180	1,5	11,0	11,0	1,5	12,5
>180	0,0	1,0	1,0	0,0	1,0
Total	177,3	265,0	238,0	150,3	415,4

* Cifras en millones de dólares

Cuadro No. 2
Devaluación Implícita Anualizada

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

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	18	37	759	1105	26	28	775	1086	17	19	1251	1471
Real	37	18	1049	704	28	26	984	673	19	17	1408	1188
Total	55	55	1808	1808	54	54	1759	1759	36	36	2659	2659

* 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 3 de septiembre se presenta la proyección de vencimientos.