

Fecha de Publicación: 18 de Julio de 2007
 Fecha de Información: 16 de Julio 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\$406,8 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de 6,3%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero		Sector Real		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	101,2	111,5	71,5	61,2	172,6
15-35	54,9	124,5	114,5	44,9	169,4
36-60	12,8	20,7	20,7	12,8	33,5
61-90	0,1	11,9	11,9	0,1	12,0
91-180	12,6	3,6	3,6	12,6	16,1
>180	0,0	3,1	3,1	0,0	3,1
Total	181,5	275,4	225,4	131,5	406,8

* Cifras en millones de dólares

Cuadro No. 2
Devaluación Implícita Anualizada

Rango	Promedio Simple	Promedio Ponderado por Monto
3-14	7,0 %	10,1 %
15-35	3,6 %	3,7 %
36-60	3,0 %	3,1 %
61-90	3,8 %	1,3 %
91-180	3,6 %	3,5 %
>180	3,8 %	4,0 %
Total	4,9 %	6,3 %

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	16 al 20 de Julio				23 al 27 de Julio				30 de Jul. al 3 de Agosto			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Financiero	13	17	973	884	7	28	1046	961	6	69	467	574
Real	17	13	777	866	28	7	808	893	69	6	527	420
Total	30	30	1749	1749	34	34	1854	1854	75	75	994	994

* 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 17 de julio se presenta la proyección de vencimientos.