

Fecha de Publicación: 19 de Julio de 2007
 Fecha de Información: 17 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\$580,1 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de -0,6%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero		Sector Real		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	252,0	58,2	58,2	252,0	310,1
15-35	129,9	70,4	70,4	129,9	200,3
36-60	10,1	1,3	1,3	10,1	11,4
61-90	4,0	21,7	21,7	4,0	25,7
91-180	18,3	6,8	6,8	18,3	25,0
>180	0,0	7,5	7,5	0,0	7,5
Total	414,3	165,8	165,8	414,3	580,1

* Cifras en millones de dólares

Cuadro No. 2
Devaluación Implícita Anualizada

Rango	Promedio Simple	Promedio Ponderado por Monto
3-14	-1,1 %	-4,0 %
15-35	3,3 %	3,2 %
36-60	3,5 %	3,5 %
61-90	3,9 %	3,4 %
91-180	3,6 %	3,3 %
>180	3,7 %	3,8 %
Total	2,2 %	-0,6 %

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	14	17	973	884	6	28	1275	1012	7	69	536	592
Real	17	14	777	866	28	6	859	1122	69	7	545	489
Total	31	31	1749	1749	34	34	2135	2135	76	76	1081	1081

* 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 18 de julio se presenta la proyección de vencimientos.