

Fecha de Publicación: 19 de Julio de 2007
 Fecha de Información: 18 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\$643,7 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de 4,4%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero		Sector Real		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	62,7	55,6	55,6	62,7	118,3
15-35	250,7	206,1	187,1	231,7	437,9
36-60	4,4	0,9	0,9	4,4	5,3
61-90	5,0	32,6	32,6	5,0	37,6
91-180	0,6	32,6	32,6	0,6	33,2
>180	5,0	6,4	6,4	5,0	11,4
Total	328,5	334,2	315,2	309,5	643,7

* Cifras en millones de dólares

Cuadro No. 2
Devaluación Implícita Anualizada

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

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	15	973	886	6	29	1330	1061	9	69	549	598
Real	15	14	779	866	29	6	908	1177	69	9	551	502
Total	29	29	1752	1752	35	35	2238	2238	78	78	1100	1100

* 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 19 de julio se presenta la proyección de vencimientos.