

Fecha de Publicación: 24 de Julio de 2007
 Fecha de Información: 19 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\$812,8 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	301,1	198,2	198,2	301,1	499,3
15-35	138,7	124,2	105,2	119,7	243,8
36-60	23,0	8,7	8,7	23,0	31,7
61-90	18,0	15,1	3,1	6,0	21,1
91-180	3,3	10,2	10,2	3,3	13,5
>180	0,1	3,2	3,2	0,1	3,4
Total	484,2	359,7	328,7	453,2	812,8

* Cifras en millones de dólares

Cuadro No. 2
Devaluación Implícita Anualizada

Rango	Promedio Simple	Promedio Ponderado por Monto
3-14	4,3 %	7,1 %
15-35	4,4 %	4,2 %
36-60	4,8 %	3,9 %
61-90	4,1 %	3,2 %
91-180	4,1 %	3,7 %
>180	3,7 %	3,9 %
Total	4,4 %	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	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	15	15	973	886	6	29	1607	1259	9	70	578	599
Real	15	15	779	866	29	6	1106	1454	70	9	552	531
Total	29	29	1752	1752	35	35	2713	2713	78	78	1129	1129

* 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 20 de julio se presenta la proyección de vencimientos.