

Fecha de Publicación: 25 de Julio de 2007
 Fecha de Información: 23 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\$621,3 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de 19,4%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero		Sector Real		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	27,5	327,0	317,0	17,5	344,5
15-35	93,0	144,4	119,9	68,5	212,8
36-60	48,3	4,7	4,7	48,3	53,0
61-90	0,7	1,8	1,8	0,7	2,5
91-180	2,0	2,8	2,8	2,0	4,8
>180	0,0	3,7	3,7	0,0	3,7
Total	171,5	484,3	449,8	137,0	621,3

* Cifras en millones de dólares

Cuadro No. 2
Devaluación Implícita Anualizada

Rango	Promedio Simple	Promedio Ponderado por Monto
3-14	11,8 %	30,4 %
15-35	5,3 %	5,8 %
36-60	4,4 %	5,5 %
61-90	4,0 %	3,7 %
91-180	3,5 %	3,5 %
>180	4,4 %	4,4 %
Total	6,7 %	19,4 %

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	23 al 27 de Julio				30 de Jul. al 3 de Agosto				6 al 10 de Agosto			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Financiero	5	24	1611	1557	9	70	601	633	4	25	593	631
Real	24	5	1404	1458	70	9	576	544	25	4	569	530
Total	29	29	3015	3015	79	79	1177	1177	30	30	1161	1161

* 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 24 de julio se presenta la proyección de vencimientos.