

Fecha de Publicación: 27 de Julio de 2007
 Fecha de Información: 25 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\$779,0 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de 4,3%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero		Sector Real		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	77,4	68,9	68,9	77,4	146,3
15-35	251,2	317,4	307,4	241,2	558,6
36-60	28,9	0,0	0,0	28,9	28,9
61-90	24,2	8,2	8,2	24,2	32,5
91-180	5,8	3,4	3,4	5,8	9,3
>180	0,6	2,8	2,8	0,6	3,4
Total	388,3	400,8	390,8	378,3	779,0

* Cifras en millones de dólares

Cuadro No. 2
Devaluación Implícita Anualizada

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

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

Sector	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	4	23	1615	1560	15	62	806	720	4	25	728	643
Real	23	4	1406	1462	62	15	663	749	25	4	580	666
Total	27	27	3021	3021	77	77	1469	1469	30	30	1308	1308

* Cifras en millones de dólares

¹ Datos provisionales.

² La fórmula para la devaluación implícita es: $((Tasa\ Pactada / Promedio\ SET\ FX) ^ (365 / Plazo)) - 1$

³ A partir del 26 de julio se presenta la proyección de vencimientos.