

Fecha de Publicación: 30 de Julio de 2007
 Fecha de Información: 26 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\$711,2 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de 9,1%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero		Sector Real		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	44,7	41,1	41,0	44,6	85,7
15-35	192,2	311,3	290,3	171,2	482,5
36-60	25,2	0,0	0,0	25,2	25,2
61-90	22,9	0,8	0,8	22,9	23,7
91-180	21,9	24,4	24,4	21,9	46,3
>180	37,9	10,0	10,0	37,9	47,9
Total	344,7	387,6	366,5	323,6	711,2

* Cifras en millones de dólares

Cuadro No. 2
Devaluación Implícita Anualizada

Rango	Promedio Simple	Promedio Ponderado por Monto
3-14	3,7 %	19,7 %
15-35	5,4 %	8,4 %
36-60	4,0 %	5,1 %
61-90	3,7 %	4,6 %
91-180	3,8 %	5,6 %
>180	4,5 %	4,7 %
Total	4,4 %	9,1 %

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	4	22	1615	1560	16	62	844	751	6	25	762	665
Real	22	4	1407	1462	62	16	694	787	25	6	590	688
Total	26	26	3021	3021	78	78	1537	1537	32	32	1353	1353

* 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 27 de julio se presenta la proyección de vencimientos.