

Fecha de Publicación: 31 de Julio de 2007
 Fecha de Información: 27 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\$400,0 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de 5,1%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero		Sector Real		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	43,9	16,6	16,6	43,9	60,5
15-35	160,0	160,0	117,0	117,0	277,0
36-60	18,7	0,0	0,0	18,7	18,7
61-90	4,5	0,0	0,0	4,5	4,5
91-180	13,1	0,0	0,0	13,1	13,1
>180	20,8	20,5	5,5	5,8	26,3
Total	261,0	197,1	139,1	203,0	400,0

* Cifras en millones de dólares

Cuadro No. 2
Devaluación Implícita Anualizada

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

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

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	22	1615	1559	16	61	871	755	7	25	778	679
Real	22	4	1406	1462	61	16	698	814	25	7	604	704
Total	27	27	3020	3020	77	77	1569	1569	32	32	1382	1382

* 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 30 de julio se presenta la proyección de vencimientos.