

Fecha de Publicación: 4 de Julio de 2007
 Fecha de Información: 28 de Junio 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\$390,3 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de 1,7%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero		Sector Real		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	79,6	63,3	20,3	36,6	99,9
15-35	121,6	78,7	75,7	118,6	197,3
36-60	18,5	1,3	1,3	18,5	19,8
61-90	0,0	4,2	4,2	0,0	4,2
91-180	0,9	5,6	5,6	0,9	6,5
>180	5,0	57,6	57,6	5,0	62,6
Total	225,6	210,7	164,7	179,6	390,3

* Cifras en millones de dólares

Cuadro No. 2
Devaluación Implícita Anualizada

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

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	25 al 29 de Junio				2 al 6 de Julio				9 al 13 de Julio			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Financiero	31	27	1326	1075	9	29	610	655	5	24	726	778
Real	27	31	855	1106	29	9	554	508	24	5	752	700
Total	58	58	2182	2182	38	38	1163	1163	29	29	1479	1479

* 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 29 de junio se presenta la proyección de vencimientos.