

Fecha de Publicación: 4 de Julio de 2007
 Fecha de Información: 29 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\$254,0 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de 3,3%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero		Sector Real		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	45,6	24,4	24,4	45,6	70,1
15-35	121,8	40,0	40,0	121,8	161,8
36-60	1,7	6,4	6,4	1,7	8,1
61-90	0,9	1,8	1,8	0,9	2,7
91-180	0,1	8,6	8,6	0,1	8,7
>180	0,3	2,4	2,4	0,3	2,7
Total	170,4	83,6	83,6	170,4	254,0

* Cifras en millones de dólares

Cuadro No. 2
Devaluación Implícita Anualizada

Rango	Promedio Simple	Promedio Ponderado por Monto
3-14	9,1 %	11,4 %
15-35	3,8 %	-0,2 %
36-60	4,1 %	0,9 %
61-90	5,0 %	3,5 %
91-180	4,7 %	5,7 %
>180	4,3 %	2,8 %
Total	5,6 %	3,3 %

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

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	25	1326	1077	10	29	632	677	5	24	748	785
Real	25	31	857	1106	29	10	576	530	24	5	759	722
Total	57	57	2183	2183	39	39	1208	1208	30	30	1507	1507

* 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 2 de julio se presenta la proyección de vencimientos.