

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.