

Fecha de Publicación: 5 de Julio de 2007
 Fecha de Información: 03 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\$259,8 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de 0,8%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero		Sector Real		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	24,4	17,2	17,2	24,4	41,6
15-35	68,5	110,7	110,7	68,5	179,2
36-60	7,1	0,7	0,7	7,1	7,8
61-90	1,8	8,1	8,1	1,8	10,0
91-180	6,6	9,1	9,1	6,6	15,7
>180	0,0	5,4	5,4	0,0	5,4
Total	108,4	151,4	151,4	108,4	259,8

* Cifras en millones de dólares

Cuadro No. 2
Devaluación Implícita Anualizada

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

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	2 al 6 de Julio				9 al 13 de Julio				16 al 20 de Julio			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Financiero	9	20	634	686	6	23	769	803	30	20	579	525
Real	20	9	585	532	23	6	777	743	20	30	468	522
Total	29	29	1218	1218	29	29	1546	1546	49	49	1047	1047

* 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 4 de julio se presenta la proyección de vencimientos.