

Fecha de Publicación: 5 de Julio de 2007
 Fecha de Información: 04 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\$105,3 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de 2,1%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero		Sector Real		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	15,3	6,2	6,2	15,3	21,5
15-35	21,6	38,9	18,9	1,6	40,4
36-60	22,0	0,1	0,1	22,0	22,1
61-90	0,0	0,2	0,2	0,0	0,2
91-180	0,1	0,1	0,1	0,1	0,2
>180	20,0	21,0	1,0	0,0	21,0
Total	78,9	66,4	26,4	38,9	105,3

* Cifras en millones de dólares

Cuadro No. 2
Devaluación Implícita Anualizada

Rango	Promedio Simple	Promedio Ponderado por Monto
3-14	6,1 %	-0,5 %
15-35	1,3 %	2,1 %
36-60	3,5 %	2,7 %
61-90	4,6 %	4,1 %
91-180	2,6 %	2,1 %
>180	22,0 %	4,2 %
Total	6,4 %	2,1 %

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

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	8	20	635	686	6	23	769	810	30	20	594	540
Real	20	8	585	533	23	6	784	743	20	30	483	537
Total	29	29	1220	1220	29	29	1553	1553	49	49	1077	1077

* Cifras en millones de dólares

¹ Datos provisionales.

² La fórmula para la devaluación implícita es: ((Tasa Pactada/Promedio SET FX) ^ (365/Plazo)) - 1

³ A partir del 5 de julio se presenta la proyección de vencimientos.