

Fecha de Publicación: 7 de Julio de 2007
 Fecha de Información: 05 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\$373,2 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de 3,2%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero		Sector Real		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	71,1	20,5	15,5	66,1	86,6
15-35	62,8	147,8	147,8	62,8	210,6
36-60	4,1	22,3	22,3	4,1	26,4
61-90	13,8	12,3	2,3	3,8	16,1
91-180	3,3	6,2	6,2	3,3	9,5
>180	20,2	13,8	3,8	10,2	24,0
Total	175,3	222,9	197,9	150,3	373,2

* Cifras en millones de dólares

Cuadro No. 2
Devaluación Implícita Anualizada

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

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	6	18	637	689	10	23	824	818	30	20	607	553
Real	18	6	587	536	23	10	787	793	20	30	496	550
Total	24	24	1224	1224	32	32	1611	1611	49	49	1103	1103

* 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 6 de julio se presenta la proyección de vencimientos.