

Fecha de Publicación: 10 de Julio de 2007
 Fecha de Información: 06 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\$507,5 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de -0,6%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero		Sector Real		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	134,5	53,2	43,2	124,5	177,7
15-35	75,6	213,3	195,3	57,6	270,9
36-60	30,1	10,5	10,5	30,1	40,6
61-90	0,4	8,9	8,9	0,4	9,3
91-180	5,4	7,8	2,8	0,4	8,2
>180	0,0	0,8	0,8	0,0	0,8
Total	246,0	294,5	261,5	213,0	507,5

* Cifras en millones de dólares

Cuadro No. 2
Devaluación Implícita Anualizada

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

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	14	637	693	10	24	940	847	30	20	624	576
Real	14	6	592	536	24	10	816	909	20	30	509	557
Total	20	20	1229	1229	34	34	1756	1756	49	49	1134	1134

* 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 9 de julio se presenta la proyección de vencimientos.