

Fecha de Publicación: 12 de Julio de 2007
 Fecha de Información: 09 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\$252,0 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de 2,3%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero		Sector Real		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	45,7	30,2	30,2	45,7	75,9
15-35	54,9	71,7	55,7	38,9	110,6
36-60	33,7	2,5	2,5	33,7	36,2
61-90	1,2	8,8	8,8	1,2	10,0
91-180	2,7	0,5	0,5	2,7	3,2
>180	10,0	16,2	6,2	0,0	16,2
Total	148,1	129,9	103,9	122,1	252,0

* Cifras en millones de dólares

Cuadro No. 2
Devaluación Implícita Anualizada

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

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

Sector	9 al 13 de Julio				16 al 20 de Julio				23 al 27 de Julio			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Financiero	10	24	942	848	30	20	668	604	4	27	865	760
Real	24	10	817	911	20	30	537	601	27	4	663	768
Total	34	34	1759	1759	50	50	1205	1205	31	31	1528	1528

* 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 10 de julio se presenta la proyección de vencimientos.