

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

| Sectores | 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.