

Fecha de Publicación: 12 de Julio de 2007
 Fecha de Información: 10 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\$519,8 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de 3,0%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero		Sector Real		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	46,6	154,9	154,9	46,6	201,6
15-35	109,2	144,8	139,8	104,2	249,0
36-60	0,1	60,0	60,0	0,1	60,1
61-90	6,0	0,8	0,8	6,0	6,8
91-180	0,2	1,3	1,3	0,2	1,5
>180	0,0	0,9	0,9	0,0	0,9
Total	162,1	362,7	357,7	157,1	519,8

* Cifras en millones de dólares

Cuadro No. 2
Devaluación Implícita Anualizada

Rango	Promedio Simple	Promedio Ponderado por Monto
3-14	10,1 %	-0,1 %
15-35	5,2 %	4,2 %
36-60	5,8 %	7,9 %
61-90	2,6 %	2,7 %
91-180	2,3 %	2,7 %
>180	4,2 %	4,1 %
Total	6,2 %	3,0 %

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	14	25	988	909	31	20	694	718	4	27	865	795
Real	25	14	878	957	20	31	651	627	27	4	698	768
Total	39	39	1867	1867	52	52	1345	1345	31	31	1563	1563

* 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 11 de julio se presenta la proyección de vencimientos.