

Fecha de Publicación: 13 de Junio de 2007

Fecha de Información: 8 de Junio 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\$561,2 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	115,9	68,1	61,1	108,9	177,0
15-35	167,8	54,2	54,2	167,8	222,0
36-60	9,0	10,8	3,8	2,0	12,8
61-90	28,9	104,8	104,8	28,9	133,7
91-180	8,3	4,7	4,7	8,3	13,0
>180	1,7	1,0	1,0	1,7	2,7
Total	331,6	243,6	229,6	317,6	561,2

* Cifras en millones de dólares

Cuadro No. 2
Devaluación Implícita Anualizada

Rango	Promedio Simple	Promedio Ponderado por Monto
3-14	-0,3 %	-0,4 %
15-35	-0,1 %	-1,0 %
36-60	1,1 %	-0,8 %
61-90	1,9 %	4,2 %
91-180	1,7 %	2,3 %
>180	2,0 %	2,5 %
Total	0,6 %	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	4 al 8 de Junio				11 al 15 de Junio				18 al 22 de Junio			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Financiero	51	37	965	1036	130	50	764	789	12	31	616	603
Real	37	51	893	822	50	130	718	692	31	12	541	555
Total	88	88	1857	1857	180	180	1482	1482	42	42	1158	1158

* 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 11 de junio se presenta la proyección de vencimientos.