

Fecha de Publicación: 14 de Mayo de 2007
 Fecha de Información: 10 de Mayo 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\$607,1 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de -0,3%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero		Sector Real		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	14,2	72,3	72,3	14,2	86,4
15-35	117,8	270,9	270,9	117,8	388,7
36-60	35,5	18,3	18,3	35,5	53,8
61-90	61,0	0,4	0,4	61,0	61,4
91-180	2,6	5,6	5,6	2,6	8,2
>180	1,8	6,9	6,9	1,8	8,6
Total	232,8	374,3	374,3	232,8	607,1

* Cifras en millones de dólares

Cuadro No. 2
Devaluación Implícita Anualizada

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

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	7 al 11 de Mayo				14 al 18 de Mayo				21 al 25 de Mayo			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Financiero	21	85	385	453	16	64	698	732	7	76	493	504
Real	85	21	350	282	64	16	568	534	76	7	395	384
Total	106	106	735	735	80	80	1266	1266	83	83	888	888

* 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 mayo se presenta la proyección de vencimientos.