

Fecha de Publicación: 11 de Abril de 2007

Fecha de Información: 9 de Abril 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\$238,6 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de 3,5%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero		Sector Real		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	28,7	25,2	21,2	24,7	49,9
15-35	19,7	52,1	52,1	19,7	71,8
36-60	68,2	11,6	7,6	64,2	75,8
61-90	0,0	0,9	0,9	0,0	0,9
91-180	5,0	11,1	11,1	5,0	16,1
>180	20,0	4,0	4,0	20,0	24,0
Total	141,7	104,8	96,8	133,7	238,6

* Cifras en millones de dólares

Cuadro No. 2
Devaluación Implícita Anualizada

Rango	Promedio Simple	Promedio Ponderado por Monto
3-14	4,5 %	11,0 %
15-35	0,5 %	2,0 %
36-60	1,9 %	0,8 %
61-90	2,3 %	2,8 %
91-180	2,8 %	2,7 %
>180	3,5 %	2,0 %
Total	2,3 %	3,5 %

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 Abril				16 al 20 de Abril				23 al 27 de Abril			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Financiero	52	38	950	731	3	28	522	490	3	48	873	632
Real	38	52	552	770	28	3	410	442	48	3	407	648
Total	91	91	1502	1502	30	30	932	932	51	51	1280	1280

* 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 10 de abril se presenta la proyección de vencimientos.