

Fecha de Publicación: 12 de Abril de 2007
 Fecha de Información: 10 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\$335,3 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de 0,9%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero		Sector Real		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	71,8	44,7	24,7	51,8	96,6
15-35	75,2	114,8	87,8	48,2	163,0
36-60	14,1	4,1	4,1	14,1	18,1
61-90	13,8	7,5	7,5	13,8	21,3
91-180	7,1	8,7	8,7	7,1	15,8
>180	0,0	20,4	20,4	0,0	20,4
Total	182,0	200,3	153,3	135,0	335,3

* Cifras en millones de dólares

Cuadro No. 2
Devaluación Implícita Anualizada

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

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	40	978	747	6	28	579	534	3	48	887	630
Real	40	52	567	799	28	6	434	479	48	3	402	660
Total	92	92	1545	1545	34	34	1013	1013	51	51	1289	1289

* 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 abril se presenta la proyección de vencimientos.