

Fecha de Publicación: 14 de Abril de 2007
 Fecha de Información: 12 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\$273,2 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de 0,4%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero		Sector Real		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	24,4	55,9	48,9	17,4	73,3
15-35	64,2	66,4	66,4	64,2	130,6
36-60	7,0	8,4	3,4	2,0	10,4
61-90	0,0	1,0	1,0	0,0	1,0
91-180	33,0	14,0	14,0	33,0	47,0
>180	0,0	10,9	10,9	0,0	10,9
Total	128,6	156,6	144,6	116,6	273,2

* Cifras en millones de dólares

Cuadro No. 2
Devaluación Implícita Anualizada

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

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	41	979	746	6	28	598	584	3	48	915	662
Real	41	52	567	799	28	6	482	496	48	3	424	678
Total	93	93	1546	1546	34	34	1080	1080	51	51	1340	1340

* 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 13 de abril se presenta la proyección de vencimientos.