

Fecha de Publicación: 17 de Abril de 2007
 Fecha de Información: 13 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\$238,4 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de -0,1%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero		Sector Real		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	56,4	24,7	14,7	46,4	71,1
15-35	64,2	44,3	27,3	47,2	91,5
36-60	27,7	5,7	5,7	27,7	33,4
61-90	12,0	3,0	3,0	12,0	15,0
91-180	12,4	8,9	8,9	12,4	21,3
>180	0,0	6,1	6,1	0,0	6,1
Total	172,8	92,6	65,6	145,8	238,4

* Cifras en millones de dólares

Cuadro No. 2
Devaluación Implícita Anualizada

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

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	36	979	746	10	29	632	606	3	46	934	666
Real	36	52	567	799	29	10	494	520	46	3	428	696
Total	88	88	1546	1546	38	38	1126	1126	49	49	1362	1362

* 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 16 de abril se presenta la proyección de vencimientos.