

Fecha de Publicación: 19 de Abril de 2007
 Fecha de Información: 17 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\$438,5 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	6,4	60,8	60,8	6,4	67,1
15-35	127,4	183,6	178,6	122,4	306,0
36-60	5,0	1,0	1,0	5,0	6,1
61-90	47,5	0,3	0,3	47,5	47,8
91-180	0,5	3,6	3,6	0,5	4,0
>180	0,0	7,5	7,5	0,0	7,5
Total	186,8	256,7	251,7	181,8	438,5

* Cifras en millones de dólares

Cuadro No. 2
Devaluación Implícita Anualizada

Rango	Promedio Simple	Promedio Ponderado por Monto
3-14	-2,1 %	-3,0 %
15-35	-0,2 %	-0,2 %
36-60	1,5 %	1,3 %
61-90	2,0 %	1,6 %
91-180	3,0 %	3,1 %
>180	3,4 %	3,4 %
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	16 al 20 de Abril				23 al 27 de Abril				30 de Abr. al 4 de Mayo			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Financiero	10	28	676	633	5	47	1037	810	0	113	483	521
Real	28	10	521	564	47	5	503	730	113	0	468	430
Total	38	38	1198	1198	52	52	1540	1540	114	114	951	951

* 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 18 de abril se presenta la proyección de vencimientos.