

Fecha de Publicación: 20 de Abril de 2007
 Fecha de Información: 18 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\$480,0 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de 1,1%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero		Sector Real		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	32,2	83,8	63,8	12,2	96,0
15-35	167,0	174,3	115,3	108,0	282,3
36-60	0,9	23,7	23,7	0,9	24,6
61-90	18,5	4,1	4,1	18,5	22,7
91-180	0,1	5,8	5,8	0,1	5,9
>180	26,0	22,4	22,4	26,0	48,4
Total	244,7	314,2	235,2	165,7	480,0

* Cifras en millones de dólares

Cuadro No. 2
Devaluación Implícita Anualizada

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

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	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	6	47	1058	834	1	113	496	596
Real	28	10	521	564	47	6	517	740	113	1	532	432
Total	38	38	1198	1198	52	52	1574	1574	114	114	1028	1028

* 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 19 de abril se presenta la proyección de vencimientos.