

Fecha de Publicación: 23 de Abril de 2007
 Fecha de Información: 19 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\$305,8 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de 3,6%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero		Sector Real		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	27,4	65,7	65,7	27,4	93,0
15-35	85,1	81,8	72,1	75,4	157,3
36-60	22,3	9,6	9,6	22,3	31,9
61-90	10,0	1,2	1,2	10,0	11,2
91-180	0,5	4,4	4,4	0,5	4,9
>180	0,5	6,9	6,9	0,5	7,5
Total	145,9	169,6	159,9	136,2	305,8

* Cifras en millones de dólares

Cuadro No. 2
Devaluación Implícita Anualizada

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

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

Sector	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	11	28	676	634	6	47	1074	886	1	113	511	614
Real	28	11	522	564	47	6	568	756	113	1	546	443
Total	39	39	1198	1198	53	53	1642	1642	114	114	1057	1057

* 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 20 de abril se presenta la proyección de vencimientos.