

Fecha de Publicación: 24 de Abril de 2007
Fecha de Información: 20 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\$434,7 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de 2,8%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero		Sector Real		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	118,6	65,2	65,2	118,6	183,8
15-35	51,2	24,4	19,4	46,2	70,6
36-60	49,2	18,8	18,8	49,2	68,0
61-90	31,0	16,1	7,1	22,0	38,1
91-180	0,3	5,0	5,0	0,3	5,3
>180	26,0	42,9	42,9	26,0	68,9
Total	276,4	172,4	158,4	262,4	434,7

* Cifras en millones de dólares

Cuadro No. 2
Devaluación Implícita Anualizada

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

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	29	677	633	7	49	1133	948	1	113	569	615
Real	29	10	521	565	49	7	631	816	113	1	547	501
Total	39	39	1198	1198	56	56	1764	1764	114	114	1116	1116

* 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 23 de abril se presenta la proyección de vencimientos.