

Fecha de Publicación: 25 de Abril de 2007
Fecha de Información: 23 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\$346,3 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de 0,5%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero		Sector Real		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	44,8	2,0	2,0	44,8	46,8
15-35	112,4	111,4	76,4	77,4	188,8
36-60	64,3	28,9	28,9	64,3	93,2
61-90	2,9	0,1	0,1	2,9	3,0
91-180	3,8	3,6	3,6	3,8	7,4
>180	0,2	6,9	6,9	0,2	7,1
Total	228,3	153,0	118,0	193,3	346,3

* Cifras en millones de dólares

Cuadro No. 2
Devaluación Implícita Anualizada

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

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	23 al 27 de Abril				30 de Abr. al 4 de Mayo				7 al 11 de Mayo			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Financiero	7	49	1140	951	1	113	606	615	4	80	279	331
Real	49	7	633	822	113	1	547	538	80	4	252	200
Total	56	56	1773	1773	114	114	1152	1152	85	85	531	531

* Cifras en millones de dólares

¹ Datos provisionales.

² La fórmula para la devaluación implícita es: $((\text{Tasa Pactada}/\text{Promedio SET FX}) \wedge (365/\text{Plazo})) - 1$

³ A partir del 24 de abril se presenta la proyección de vencimientos.