

Fecha de Publicación: 26 de Abril de 2007
Fecha de Información: 24 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\$524,8 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de 2,0%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero		Sector Real		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	47,1	108,9	80,9	19,1	128,0
15-35	131,6	130,1	82,1	83,6	213,7
36-60	15,2	3,0	3,0	15,2	18,2
61-90	41,2	60,1	60,1	41,2	101,3
91-180	31,5	8,8	8,8	31,5	40,3
>180	23,3	0,0	0,0	23,3	23,3
Total	289,8	311,0	235,0	213,8	524,8

* Cifras en millones de dólares

Cuadro No. 2
Devaluación Implícita Anualizada

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

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	9	49	1154	969	1	113	630	702	4	80	287	339
Real	49	9	642	827	113	1	616	544	80	4	260	209
Total	58	58	1796	1796	114	114	1246	1246	85	85	548	548

* 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 25 de abril se presenta la proyección de vencimientos.