

Fecha de Publicación: 3 de Mayo de 2007
 Fecha de Información: 30 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\$264,5 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de 0,3%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero		Sector Real		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	14,2	11,1	1,1	4,2	15,2
15-35	95,9	74,1	66,1	87,9	162,0
36-60	31,3	3,9	3,9	31,3	35,3
61-90	0,4	1,1	1,1	0,4	1,5
91-180	17,3	15,1	14,5	16,8	31,9
>180	10,0	8,7	8,7	10,0	18,7
Total	169,1	114,0	95,4	150,5	264,5

* Cifras en millones de dólares

Cuadro No. 2
Devaluación Implícita Anualizada

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

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	30 de Abr. al 4 de Mayo				7 al 11 de Mayo				14 al 18 de Mayo			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Financiero	5	114	677	746	7	95	306	374	10	67	648	619
Real	114	5	650	581	95	7	286	217	67	10	461	490
Total	119	119	1328	1328	103	103	592	592	77	77	1109	1109

* 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 1 de mayo se presenta la proyección de vencimientos.