

Fecha de Publicación: 23 de Mayo de 2007
 Fecha de Información: 18 de Mayo 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\$215,9 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	15,0	40,4	40,4	15,0	55,4
15-35	45,9	58,7	48,7	35,9	94,6
36-60	3,1	6,3	6,3	3,1	9,4
61-90	4,4	14,4	14,4	4,4	18,8
91-180	4,3	10,4	9,9	3,8	14,2
>180	7,0	16,5	16,5	7,0	23,5
Total	79,7	146,7	136,2	69,2	215,9

* Cifras en millones de dólares

Cuadro No. 2
Devaluación Implícita Anualizada

Rango	Promedio Simple	Promedio Ponderado por Monto
3-14	2,4 %	1,3 %
15-35	3,4 %	1,9 %
36-60	3,3 %	2,5 %
61-90	2,9 %	2,5 %
91-180	2,7 %	2,5 %
>180	3,2 %	2,8 %
Total	2,9 %	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	14 al 18 de Mayo				21 al 25 de Mayo				28 de May. al 1 de Junio			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Financiero	17	49	770	813	11	82	624	705	5	159	773	661
Real	49	17	646	603	82	11	592	511	159	5	496	608
Total	67	67	1416	1416	93	93	1216	1216	164	164	1269	1269

* 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 21 de mayo se presenta la proyección de vencimientos.