

Fecha de Publicación: 23 de Mayo de 2007
 Fecha de Información: 22 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\$442,2 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de 3,1%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero		Sector Real		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	64,2	54,4	44,4	54,2	108,5
15-35	105,0	113,3	108,3	100,0	213,3
36-60	41,1	12,5	2,5	31,1	43,6
61-90	18,9	2,3	2,3	18,9	21,1
91-180	5,9	18,3	13,3	0,9	19,2
>180	24,3	12,1	12,1	24,3	36,4
Total	259,4	212,7	182,7	229,4	442,2

* Cifras en millones de dólares

Cuadro No. 2
Devaluación Implícita Anualizada

Rango	Promedio Simple	Promedio Ponderado por Monto
3-14	2,5 %	4,4 %
15-35	1,9 %	2,3 %
36-60	2,5 %	4,0 %
61-90	2,5 %	3,6 %
91-180	2,8 %	2,7 %
>180	2,8 %	2,3 %
Total	2,4 %	3,1 %

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	21 al 25 de Mayo				28 de May. al 1 de Junio				4 al 8 de Junio			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Financiero	8	75	628	712	5	158	822	700	2	57	526	788
Real	75	8	600	516	158	5	535	657	57	2	680	418
Total	83	83	1228	1228	163	163	1357	1357	59	59	1205	1205

* 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 mayo se presenta la proyección de vencimientos.