

Fecha de Publicación: 12 de Marzo de 2007

Fecha de Información: 8 de Marzo 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\$423,8 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de 3,5%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero		Sector Real		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	52,1	34,5	12,5	30,1	64,6
15-35	125,5	152,4	140,4	113,5	265,9
36-60	20,0	11,6	11,6	20,0	31,6
61-90	1,0	1,2	1,2	1,0	2,2
91-180	0,2	15,1	15,1	0,1	15,2
>180	0,0	44,3	44,3	0,0	44,3
Total	198,8	259,1	225,0	164,7	423,8

* Cifras en millones de dólares

Cuadro No. 2
Devaluación Implícita Anualizada

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

En el cuadro No. 3 se presentan los vencimientos de forwards para ésta y las próximas dos semanas.³

¹ Datos provisionales.

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

³ A partir del 9 de marzo se presenta la proyección de vencimientos.

Cuadro No. 3
Vencimientos de Forwards

Sectores	5 al 9 de Marzo				12 al 16 de Marzo				19 al 23 de Marzo			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Financiero	43	26	806	977	29	26	761	651	60	21	448	508
Real	26	43	733	561	26	29	507	617	21	60	447	387
Total	70	70	1539	1539	55	55	1268	1268	82	82	894	894

* Cifras en millones de dólares