

Fecha de Publicación: 10 de Abril de 2007

Fecha de Información: 4 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\$189,8 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de -0,5%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero		Sector Real		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	27,6	16,1	0,1	11,6	27,7
15-35	26,8	71,1	60,1	15,8	86,8
36-60	10,0	19,1	9,1	0,0	19,1
61-90	30,5	14,4	14,4	30,5	44,9
91-180	10,0	10,4	0,4	0,0	10,4
>180	0,0	0,9	0,9	0,0	0,9
Total	104,9	132,0	85,0	57,9	189,8

* Cifras en millones de dólares

Cuadro No. 2
Devaluación Implícita Anualizada

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

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 5 de abril se presenta la proyección de vencimientos.

Cuadro No. 3
Vencimientos de Forwards

Sectores	2 al 6 de Abril				9 al 13 de Abril				16 al 20 de Abril			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Financiero	18	10	812	845	49	39	933	730	3	28	513	466
Real	10	18	643	610	39	49	550	753	28	3	390	437
Total	28	28	1455	1455	88	88	1484	1484	31	31	903	903

* Cifras en millones de dólares