

Fecha de Publicación: 8 de Marzo de 2007
 Fecha de Información: 6 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\$367,1 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de 4,0%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero		Sector Real		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	62,0	62,6	29,4	28,8	91,4
15-35	76,4	132,2	117,5	61,7	193,9
36-60	0,0	49,6	49,6	0,0	49,6
61-90	0,0	1,8	1,8	0,0	1,8
91-180	0,0	3,4	3,4	0,0	3,4
>180	25,0	2,1	2,1	25,0	27,1
Total	163,4	251,7	203,7	115,4	367,1

* Cifras en millones de dólares

Cuadro No. 2
Devaluación Implícita Anualizada

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

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 7 de marzo se presenta la proyección de vencimientos.

Cuadro No. 3
Vencimientos de Forwards

Sector	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	27	806	977	30	26	741	607	45	21	388	484
Real	27	43	732	561	26	30	470	604	21	45	444	348
Total	70	70	1538	1538	56	56	1211	1211	66	66	832	832

* Cifras en millones de dólares