

Fecha de Publicación: 15 de Marzo de 2007
 Fecha de Información: 13 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\$407,7 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	64,3	36,1	11,1	39,3	75,4
15-35	128,5	146,3	75,3	57,5	203,9
36-60	0,1	31,7	31,7	0,1	31,8
61-90	0,0	3,9	3,9	0,0	3,9
91-180	85,0	6,7	6,7	85,0	91,7
>180	0,0	1,1	1,1	0,0	1,1
Total	277,9	225,8	129,8	181,9	407,7

* Cifras en millones de dólares

Cuadro No. 2
Devaluación Implícita Anualizada

Rango	Promedio Simple	Promedio Ponderado por Monto
3-14	3,3 %	5,0 %
15-35	3,3 %	3,4 %
36-60	3,5 %	3,9 %
61-90	3,7 %	2,9 %
91-180	3,1 %	2,4 %
>180	3,5 %	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: $((\text{Tasa Pactada}/\text{Promedio SET FX}) \wedge (365/\text{Plazo})) - 1$

³ A partir del 14 de marzo se presenta la proyección de vencimientos.

Cuadro No. 3
Vencimientos de Forwards

Sector	12 al 16 de Marzo				19 al 23 de Marzo				26 al 30 de Marzo			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Financiero	30	27	790	717	84	22	552	583	35	23	663	534
Real	27	30	561	634	22	84	488	457	23	35	416	546
Total	57	57	1351	1351	106	106	1039	1039	58	58	1080	1080

* Cifras en millones de dólares