

Fecha de Publicación: 20 de Marzo de 2007
Fecha de Información: 15 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\$449,5 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de 3,4%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero		Sector Real		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	77,6	39,0	38,5	77,1	116,1
15-35	198,5	105,8	69,8	162,5	268,3
36-60	4,4	10,8	10,8	4,4	15,2
61-90	0,0	14,2	14,2	0,0	14,2
91-180	0,5	22,5	22,5	0,5	23,0
>180	10,0	2,6	2,6	10,0	12,6
Total	291,0	195,0	158,5	254,5	449,5

* Cifras en millones de dólares

Cuadro No. 2
Devaluación Implícita Anualizada

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

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 16 de marzo se presenta la proyección de vencimientos.

Cuadro No. 3
Vencimientos de Forwards

Sectores	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	38	27	782	717	115	23	617	664	35	23	726	598
Real	27	38	561	627	23	115	568	522	23	35	480	609
Total	65	65	1343	1343	138	138	1186	1186	58	58	1206	1206

* Cifras en millones de dólares