

Fecha de Publicación: 21 de Marzo de 2007
Fecha de Información: 16 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\$229,3 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de 2,0%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero		Sector Real		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	30,5	28,1	27,6	30,0	58,1
15-35	91,5	23,4	13,4	81,5	105,0
36-60	26,6	0,1	0,1	26,6	26,7
61-90	5,4	0,1	0,1	5,4	5,5
91-180	29,2	3,4	3,4	29,2	32,6
>180	1,1	0,3	0,3	1,1	1,4
Total	184,4	55,5	45,0	173,9	229,3

* Cifras en millones de dólares

Cuadro No. 2
Devaluación Implícita Anualizada

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

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: $((\text{Tasa Pactada}/\text{Promedio SET FX}) \wedge (365/\text{Plazo})) - 1$

³ A partir del 19 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	21	782	723	115	22	621	666	36	23	752	625
Real	21	38	567	627	22	115	570	526	23	36	507	634
Total	59	59	1349	1349	137	137	1191	1191	60	60	1259	1259

* Cifras en millones de dólares