

Fecha de Publicación: 23 de Marzo de 2007
 Fecha de Información: 21 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\$303,6 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	13,7	34,8	34,3	13,2	48,0
15-35	111,9	58,5	57,5	110,9	169,4
36-60	12,0	2,5	2,5	12,0	14,5
61-90	20,0	27,4	12,4	5,0	32,4
91-180	20,4	7,6	7,6	20,4	28,0
>180	0,5	10,8	10,8	0,5	11,3
Total	178,6	141,6	125,1	162,1	303,6

* Cifras en millones de dólares

Cuadro No. 2
Devaluación Implícita Anualizada

Rango	Promedio Simple	Promedio Ponderado por Monto
3-14	6,7 %	9,1 %
15-35	2,9 %	2,8 %
36-60	4,4 %	6,2 %
61-90	3,3 %	2,9 %
91-180	3,3 %	3,0 %
>180	3,3 %	3,8 %
Total	3,8 %	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 22 de marzo se presenta la proyección de vencimientos.

Cuadro No. 3
Vencimientos de Forwards

Sector	19 al 23 de Marzo				26 al 30 de Marzo				2 al 6 de Abril			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Financiero	116	24	650	664	40	25	855	764	48	12	500	668
Real	24	116	568	554	25	40	639	730	12	48	570	402
Total	139	139	1218	1218	65	65	1494	1494	60	60	1069	1069

* Cifras en millones de dólares