

Fecha de Publicación: 27 de Marzo de 2007
 Fecha de Información: 23 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\$271,5 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de 1,7%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero		Sector Real		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	48,4	58,9	43,9	33,4	92,2
15-35	124,1	73,8	31,3	81,6	155,4
36-60	0,7	10,4	10,4	0,7	11,1
61-90	0,0	0,4	0,4	0,0	0,4
91-180	0,1	9,6	9,6	0,1	9,7
>180	0,0	2,6	2,6	0,0	2,6
Total	173,3	155,7	98,2	115,8	271,5

* Cifras en millones de dólares

Cuadro No. 2
Devaluación Implícita Anualizada

Rango	Promedio Simple	Promedio Ponderado por Monto
3-14	2,3 %	0,7 %
15-35	2,4 %	2,2 %
36-60	3,3 %	3,0 %
61-90	3,5 %	3,0 %
91-180	3,4 %	3,3 %
>180	3,2 %	3,3 %
Total	2,7 %	1,7 %

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 26 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	23	650	665	42	25	904	832	48	13	564	715
Real	23	116	569	554	25	42	707	780	13	48	580	429
Total	139	139	1219	1219	67	67	1611	1611	61	61	1145	1145

* Cifras en millones de dólares