

Fecha de Publicación: 29 de Marzo de 2007
Fecha de Información: 27 de Marzo de 2007¹

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Según el reporte de los Intermediarios del Mercado Cambiario durante el día se pactó un total de US\$399,6 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de 0,8%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero		Sector Real		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	96,9	105,4	45,4	36,9	142,2
15-35	157,3	120,8	47,8	84,3	205,1
36-60	0,0	32,9	32,9	0,0	32,9
61-90	10,0	11,5	1,5	0,0	11,5
91-180	3,0	7,8	4,8	0,0	7,8
>180	0,0	0,1	0,1	0,0	0,1
Total	267,2	278,4	132,4	121,2	399,6

* Cifras en millones de dólares

Cuadro No. 2
Devaluación Implícita Anualizada

Rango	Promedio Simple	Promedio Ponderado por Monto
3-14	-0,1 %	-1,5 %
15-35	2,1 %	1,9 %
36-60	2,8 %	2,6 %
61-90	3,0 %	1,9 %
91-180	3,0 %	2,7 %
>180	3,2 %	3,2 %
Total	1,8 %	0,8 %

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 28 de marzo se presenta la proyección de vencimientos.

Cuadro No. 3
Vencimientos de Forwards

Sector	26 al 30 de Marzo				2 al 6 de Abril				9 al 13 de Abril			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Financiero	42	27	940	893	49	13	658	778	34	38	842	513
Real	27	42	745	791	13	49	603	483	38	34	359	688
Total	69	69	1684	1684	61	61	1261	1261	72	72	1201	1201

* Cifras en millones de dólares