

Fecha de Publicación: 3 de Abril de 2007
 Fecha de Información: 30 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\$771,8 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	37,1	27,8	20,8	30,1	57,9
15-35	393,7	134,3	109,3	368,7	503,0
36-60	85,2	87,5	87,5	85,2	172,7
61-90	3,5	7,5	7,5	3,5	11,0
91-180	12,0	5,7	5,7	12,0	17,7
>180	1,1	8,3	8,3	1,1	9,4
Total	532,7	271,1	239,1	500,7	771,8

* Cifras en millones de dólares

Cuadro No. 2
Devaluación Implícita Anualizada

Rango	Promedio Simple	Promedio Ponderado por Monto
3-14	-0,2 %	25,1 %
15-35	-3,4 %	-5,5 %
36-60	-1,6 %	-1,1 %
61-90	-0,7 %	-3,8 %
91-180	0,2 %	-0,7 %
>180	1,0 %	2,2 %
Total	-1,4 %	-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: $((Tasa\ Pactada / Promedio\ SET\ FX) ^ (365 / Plazo)) - 1$

³ A partir del 2 de abril 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	43	29	940	894	35	10	795	845	46	39	862	623
Real	29	43	745	792	10	35	643	593	39	46	469	708
Total	72	72	1686	1686	45	45	1438	1438	85	85	1331	1331

* Cifras en millones de dólares