

Fecha de Publicación: 9 de Abril de 2007

Fecha de Información: 3 de Abril 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\$375,6 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de -2,6%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero		Sector Real		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	40,2	56,5	56,5	40,2	96,6
15-35	34,4	166,2	149,2	17,4	183,6
36-60	3,0	3,6	3,6	3,0	6,6
61-90	26,5	9,8	9,8	26,5	36,4
91-180	17,1	22,0	5,0	0,1	22,2
>180	22,0	8,1	8,1	22,0	30,1
Total	143,3	266,3	232,3	109,3	375,6

* Cifras en millones de dólares

Cuadro No. 2
Devaluación Implícita Anualizada

Rango	Promedio Simple	Promedio Ponderado por Monto
3-14	-4,3 %	-7,6 %
15-35	-0,9 %	-1,8 %
36-60	0,1 %	-1,7 %
61-90	-0,3 %	-0,5 %
91-180	1,7 %	1,8 %
>180	3,1 %	2,5 %
Total	-1,2 %	-2,6 %

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 4 de abril se presenta la proyección de vencimientos.

Cuadro No. 3
Vencimientos de Forwards

Sectores	2 al 6 de Abril				9 al 13 de Abril				16 al 20 de Abril			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Financiero	24	10	806	845	47	39	910	714	3	28	511	465
Real	10	24	643	604	39	47	550	746	28	3	388	435
Total	34	34	1449	1449	86	86	1460	1460	31	31	899	899

* Cifras en millones de dólares