

Fecha de Publicación: 6 de Marzo de 2007
 Fecha de Información: 2 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\$557,5 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de 2,9%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero		Sector Real		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	151,1	95,0	59,0	115,1	210,1
15-35	103,6	166,8	129,8	66,6	233,4
36-60	1,2	1,0	1,0	1,2	2,2
61-90	0,4	0,0	0,0	0,4	0,4
91-180	30,6	2,1	2,1	30,6	32,7
>180	2,0	76,5	76,5	2,0	78,6
Total	289,0	341,5	268,5	216,0	557,5

* Cifras en millones de dólares

Cuadro No. 2
Devaluación Implícita Anualizada

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

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 5 de marzo se presenta la proyección de vencimientos.

Cuadro No. 3
Vencimientos de Forwards

Sector	26 de Feb. al 2 de Marzo				5 al 9 de Marzo				12 al 16 de Marzo			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Financiero	48	39	952	833	43	26	770	943	30	25	706	541
Real	39	48	705	824	26	43	716	544	25	30	419	584
Total	87	87	1657	1657	69	69	1487	1487	55	55	1124	1124

* Cifras en millones de dólares