

Fecha de Publicación: 20 de Febrero de 2007
 Fecha de Información: 16 de Febrero 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\$154,3 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de 3,3%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero		Sector Real		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	14,6	44,0	44,0	14,6	58,6
15-35	44,2	28,3	28,3	44,2	72,5
36-60	6,0	0,2	0,2	6,0	6,2
61-90	2,5	11,2	11,2	2,5	13,7
91-180	0,0	3,1	3,1	0,0	3,1
>180	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
Total	67,4	86,9	86,9	67,4	154,3

* Cifras en millones de dólares

Cuadro No. 2
Devaluación Implícita Anualizada

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

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 19 de febrero se presenta la proyección de vencimientos.

Cuadro No. 3
Vencimientos de Forwards

Sector	12 al 16 de Febrero				19 al 23 de Febrero				26 de Feb. al 2 de Marzo			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Financiero	141	35	889	929	48	30	871	864	47	39	858	658
Real	35	141	754	714	30	48	614	621	39	47	531	730
Total	176	176	1643	1643	79	79	1485	1485	86	86	1389	1389

* Cifras en millones de dólares