

Fecha de Publicación: 22 de Febrero de 2007
 Fecha de Información: 20 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\$222,7 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de 1,7%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero		Sector Real		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	40,4	35,0	27,0	32,4	67,3
15-35	80,4	54,7	33,7	59,4	114,1
36-60	12,0	7,7	7,7	12,0	19,7
61-90	0,2	13,1	13,1	0,2	13,2
91-180	0,2	4,9	4,9	0,2	5,1
>180	0,0	3,3	3,3	0,0	3,3
Total	133,1	118,6	89,6	104,1	222,7

* Cifras en millones de dólares

Cuadro No. 2
Devaluación Implícita Anualizada

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

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 21 de febrero se presenta la proyección de vencimientos.

Cuadro No. 3
Vencimientos de Forwards

Sector	19 al 23 de Febrero				26 de Feb. al 2 de Marzo				5 al 9 de Marzo			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Financiero	49	31	899	870	48	39	864	685	38	25	493	557
Real	31	49	620	649	39	48	558	737	25	38	421	357
Total	79	79	1519	1519	87	87	1422	1422	63	63	914	914

* Cifras en millones de dólares