

Fecha de Publicación: 7 de Febrero de 2007
 Fecha de Información: 5 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\$241,1 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de 2,8%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero		Sector Real		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	45,3	21,5	21,5	45,3	66,8
15-35	58,6	101,5	50,5	7,6	109,1
36-60	0,4	3,9	3,9	0,4	4,3
61-90	20,0	5,7	0,7	15,0	20,7
91-180	0,2	27,0	27,0	0,2	27,2
>180	7,2	5,8	5,8	7,2	13,0
Total	131,7	165,4	109,4	75,7	241,1

* Cifras en millones de dólares

Cuadro No. 2
Devaluación Implícita Anualizada

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

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 6 de febrero se presenta la proyección de vencimientos.

Cuadro No. 3
Vencimientos de Forwards

Sectores	5 al 9 de Febrero				12 al 16 de Febrero				19 al 23 de Febrero			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Financiero	58	24	857	808	36	35	802	802	24	26	680	625
Real	24	58	629	678	35	36	657	657	26	24	454	509
Total	81	81	1486	1486	71	71	1459	1459	50	50	1134	1134

* Cifras en millones de dólares