

Fecha de Publicación: 8 de Febrero de 2007
 Fecha de Información: 6 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\$417,2 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de 2,3%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero		Sector Real		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	24,6	14,8	14,8	24,6	39,4
15-35	187,4	190,7	166,7	163,4	354,1
36-60	1,4	7,6	7,6	1,4	9,0
61-90	0,5	11,7	11,7	0,5	12,1
91-180	0,0	0,8	0,8	0,0	0,8
>180	0,0	1,9	1,9	0,0	1,9
Total	213,9	227,3	203,3	189,9	417,2

* Cifras en millones de dólares

Cuadro No. 2
Devaluación Implícita Anualizada

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

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 7 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	60	24	868	809	39	35	809	816	27	27	684	646
Real	24	60	630	689	35	39	671	664	27	27	474	513
Total	84	84	1498	1498	74	74	1479	1479	53	53	1158	1158

* Cifras en millones de dólares