

Fecha de Publicación: 12 de Febrero de 2007

Fecha de Información: 8 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\$435,1 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de 3,5%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero		Sector Real		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	44,6	52,0	42,0	34,6	86,6
15-35	61,5	225,1	223,1	59,5	284,6
36-60	0,1	52,7	52,7	0,1	52,8
61-90	10,5	10,3	0,3	0,5	10,8
91-180	0,0	0,2	0,2	0,0	0,2
>180	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
Total	116,7	340,4	318,4	94,7	435,1

* Cifras en millones de dólares

Cuadro No. 2
Devaluación Implícita Anualizada

Rango	Promedio Simple	Promedio Ponderado por Monto
3-14	2,1 %	3,5 %
15-35	3,3 %	3,4 %
36-60	3,6 %	4,5 %
61-90	3,2 %	3,2 %
91-180	3,1 %	3,1 %
>180	3,4 %	3,3 %
Total	2,9 %	3,5 %

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 9 de febrero se presenta la proyección de vencimientos.

Cuadro No. 3
Vencimientos de Forwards

Sector	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	61	21	868	811	115	37	821	866	27	27	709	662
Real	21	61	631	689	37	115	711	666	27	27	490	537
Total	81	81	1499	1499	153	153	1532	1532	54	54	1199	1199

* Cifras en millones de dólares