

Fecha de Publicación: 16 de Febrero de 2007
 Fecha de Información: 14 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\$334,1 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de 2,7%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero		Sector Real		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	38,8	53,5	38,5	23,8	77,3
15-35	127,5	66,5	51,5	112,5	179,0
36-60	0,3	0,3	0,3	0,3	0,6
61-90	2,7	14,6	14,6	2,7	17,3
91-180	8,6	21,9	21,9	8,6	30,5
>180	24,5	5,0	5,0	24,5	29,5
Total	202,3	161,8	131,8	172,3	334,1

* Cifras en millones de dólares

Cuadro No. 2
Devaluación Implícita Anualizada

Rango	Promedio Simple	Promedio Ponderado por Monto
3-14	0,5 %	2,3 %
15-35	3,1 %	2,8 %
36-60	4,8 %	2,6 %
61-90	3,0 %	2,8 %
91-180	3,2 %	2,7 %
>180	3,0 %	2,8 %
Total	2,4 %	2,7 %

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 15 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	140	38	864	903	49	28	860	814	46	37	872	662
Real	38	140	728	689	28	49	564	610	37	46	534	744
Total	178	178	1592	1592	77	77	1424	1424	83	83	1406	1406

* Cifras en millones de dólares