

Fecha de Publicación: 19 de Febrero de 2007
 Fecha de Información: 15 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\$195,3 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	2,4	29,9	29,9	2,4	32,2
15-35	90,5	55,4	40,4	75,5	130,9
36-60	0,1	3,8	3,8	0,1	3,9
61-90	0,3	0,1	0,1	0,3	0,3
91-180	0,2	1,1	1,1	0,2	1,3
>180	25,0	1,7	1,7	25,0	26,7
Total	118,4	91,9	76,9	103,4	195,3

* Cifras en millones de dólares

Cuadro No. 2
Devaluación Implícita Anualizada

Rango	Promedio Simple	Promedio Ponderado por Monto
3-14	2,8 %	3,0 %
15-35	2,5 %	2,7 %
36-60	3,3 %	3,0 %
61-90	3,1 %	2,9 %
91-180	3,4 %	3,2 %
>180	3,3 %	2,8 %
Total	2,9 %	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 16 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	141	36	864	903	48	30	861	830	47	39	879	673
Real	36	141	728	689	30	48	581	611	39	47	545	751
Total	177	177	1592	1592	79	79	1441	1441	86	86	1424	1424

* Cifras en millones de dólares