

Fecha de Publicación: 23 de Febrero de 2007
 Fecha de Información: 21 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\$197,0 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de 4,0%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero		Sector Real		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	9,6	5,6	5,6	9,6	15,2
15-35	78,2	123,9	82,9	37,2	161,1
36-60	10,3	0,8	0,8	10,3	11,1
61-90	1,0	5,7	5,7	1,0	6,7
91-180	0,0	1,1	1,1	0,0	1,1
>180	0,0	1,7	1,7	0,0	1,7
Total	99,2	138,8	97,8	58,2	197,0

* Cifras en millones de dólares

Cuadro No. 2
Devaluación Implícita Anualizada

Rango	Promedio Simple	Promedio Ponderado por Monto
3-14	2,0 %	1,4 %
15-35	3,7 %	4,3 %
36-60	3,5 %	2,9 %
61-90	3,1 %	3,0 %
91-180	3,3 %	3,2 %
>180	3,2 %	3,3 %
Total	3,1 %	4,0 %

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 22 de febrero se presenta la proyección de vencimientos.

Cuadro No. 3
Vencimientos de Forwards

Sector	19 al 23 de Febrero				26 de Feb. al 2 de Marzo				5 al 9 de Marzo			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Financiero	49	30	899	870	48	42	873	688	38	25	515	581
Real	30	49	620	649	42	48	561	745	25	38	425	359
Total	79	79	1519	1519	90	90	1433	1433	63	63	940	940

* Cifras en millones de dólares