

Fecha de Publicación: 26 de Febrero de 2007
 Fecha de Información: 22 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\$375,8 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de 3,1%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero		Sector Real		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	45,8	62,7	52,7	35,8	98,5
15-35	158,8	116,2	94,2	136,8	253,0
36-60	2,0	6,4	6,4	2,0	8,4
61-90	0,7	1,2	1,2	0,7	1,8
91-180	0,0	9,5	9,5	0,0	9,6
>180	0,2	4,3	4,3	0,2	4,5
Total	207,5	200,3	168,3	175,5	375,8

* Cifras en millones de dólares

Cuadro No. 2
Devaluación Implícita Anualizada

Rango	Promedio Simple	Promedio Ponderado por Monto
3-14	3,4 %	3,5 %
15-35	3,1 %	2,9 %
36-60	3,4 %	2,8 %
61-90	3,4 %	3,3 %
91-180	3,3 %	3,3 %
>180	3,3 %	3,3 %
Total	3,3 %	3,1 %

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 23 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	48	30	900	870	48	43	908	729	39	25	528	604
Real	30	48	621	650	43	48	601	780	25	39	436	361
Total	78	78	1520	1520	91	91	1509	1509	64	64	965	965

* Cifras en millones de dólares