

Fecha de Publicación: 27 de Febrero de 2007
 Fecha de Información: 23 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\$221,2 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de 3,6%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero		Sector Real		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	30,9	59,7	59,7	30,9	90,6
15-35	64,6	55,7	55,7	64,6	120,4
36-60	1,0	0,2	0,2	1,0	1,2
61-90	0,0	0,2	0,2	0,0	0,2
91-180	1,9	2,4	2,4	1,9	4,2
>180	0,8	3,8	3,8	0,8	4,6
Total	99,2	122,0	122,0	99,2	221,2

* Cifras en millones de dólares

Cuadro No. 2
Devaluación Implícita Anualizada

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

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 26 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	900	870	47	43	921	770	39	25	545	622
Real	30	49	621	650	43	47	642	794	25	39	454	378
Total	79	79	1520	1520	90	90	1564	1564	64	64	1000	1000

* Cifras en millones de dólares