

Fecha de Publicación: 28 de Febrero de 2007
 Fecha de Información: 26 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\$607,2 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de 4,6%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero		Sector Real		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	40,5	112,4	112,4	40,5	152,9
15-35	129,4	89,3	74,8	114,9	204,2
36-60	0,0	23,5	23,5	0,0	23,5
61-90	0,0	5,7	5,7	0,0	5,7
91-180	170,0	15,2	15,2	170,0	185,2
>180	25,0	10,6	10,6	25,0	35,6
Total	365,0	256,7	242,2	350,5	607,2

* Cifras en millones de dólares

Cuadro No. 2
Devaluación Implícita Anualizada

Rango	Promedio Simple	Promedio Ponderado por Monto
3-14	9,1 %	10,3 %
15-35	2,4 %	1,7 %
36-60	3,1 %	3,4 %
61-90	3,0 %	3,6 %
91-180	3,5 %	3,4 %
>180	3,7 %	2,8 %
Total	4,3 %	4,6 %

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 27 de febrero se presenta la proyección de vencimientos.

Cuadro No. 3
Vencimientos de Forwards

Sector	26 de Feb. al 2 de Marzo				5 al 9 de Marzo				12 al 16 de Marzo			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Financiero	46	44	950	828	39	26	549	664	26	25	606	431
Real	44	46	700	822	26	39	496	381	25	26	313	487
Total	90	90	1650	1650	65	65	1045	1045	51	51	918	918

* Cifras en millones de dólares