

Fecha de Publicación: 2 de Marzo de 2007
Fecha de Información: 28 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\$489,9 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de 2,4%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

| Rango | Sector Financiero | | Sector Real | | Total |
|--------------|-------------------|--------------|--------------|--------------|--------------|
| | Compras | Ventas | Compras | Ventas | |
| 3-14 | 53,8 | 118,0 | 113,0 | 48,8 | 166,8 |
| 15-35 | 185,9 | 122,5 | 93,5 | 156,9 | 279,4 |
| 36-60 | 9,1 | 0,0 | 0,0 | 9,1 | 9,1 |
| 61-90 | 12,6 | 1,7 | 1,7 | 12,6 | 14,2 |
| 91-180 | 5,9 | 7,4 | 2,4 | 0,9 | 8,3 |
| >180 | 1,8 | 10,3 | 10,3 | 1,8 | 12,1 |
| Total | 269,0 | 259,9 | 220,9 | 230,0 | 489,9 |

* Cifras en millones de dólares

Cuadro No. 2
Devaluación Implícita Anualizada

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

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 1 de marzo 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 | 48 | 39 | 952 | 833 | 41 | 26 | 605 | 823 | 26 | 25 | 653 | 468 |
| Real | 39 | 48 | 705 | 824 | 26 | 41 | 630 | 412 | 25 | 26 | 348 | 533 |
| Total | 87 | 87 | 1657 | 1657 | 67 | 67 | 1235 | 1235 | 52 | 52 | 1002 | 1002 |

* Cifras en millones de dólares