

Fecha de Publicación: 23 de Enero de 2007
 Fecha de Información: 19 de Enero 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\$294,3 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de 2,9%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero		Sector Real		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	23,8	15,1	9,3	18,0	33,1
15-35	177,0	31,3	21,3	167,0	198,2
36-60	26,4	0,9	0,9	26,4	27,4
61-90	28,6	10,8	5,8	23,6	34,3
91-180	0,0	1,1	1,1	0,0	1,1
>180	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
Total	255,8	59,3	38,5	235,0	294,3

* Cifras en millones de dólares

Cuadro No. 2
Devaluación Implícita Anualizada

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

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 enero se presenta la proyección de vencimientos.

Cuadro No. 3
Vencimientos de Forwards

Sectores	15 al 19 de Enero				22 al 26 de Enero				29 de Ene. al 2 de Febrero			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Financiero	129	26	1034	925	70	42	695	801	23	34	822	
Real	26	129	721	830	42	70	578	472	34	23	357	
Total	155	155	1755	1755	112	112	1273	1273	58	58	1179	1

* Cifras en millones de dólares