

Fecha de Publicación: 9 de Enero de 2007
Fecha de Información: 4 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\$218,3 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de 3,2%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero		Sector Real		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	3,9	38,9	38,9	3,9	42,7
15-35	78,1	56,1	55,1	77,1	133,2
36-60	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
61-90	0,5	0,6	0,6	0,5	1,0
91-180	10,2	0,2	0,2	10,2	10,4
>180	30,6	0,2	0,2	30,6	30,8
Total	123,3	96,0	95,0	122,3	218,3

* Cifras en millones de dólares

Cuadro No. 2
Devaluación Implícita Anualizada

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

En el cuadro No. 3 se presentan los vencimientos de forwards para ésta y las próximas dos semanas.³

Cuadro No. 3
Vencimientos de Forwards

Sectores	1 al 5 de Enero				8 al 12 de Enero				15 al 19 de Enero			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Financiero	56	16	581	497	156	46	692	622	86	24	886	837
Real	16	56	280	364	46	156	466	536	24	86	649	699
Total	72	72	861	861	202	202	1158	1158	110	110	1535	1535

* Cifras en millones de dólares

¹ Datos provisionales.

² La fórmula para la devaluación implícita es: $((\text{Tasa Pactada}/\text{Promedio SET FX}) \wedge (365/\text{Plazo})) - 1$

³ A partir del 5 de enero se presenta la proyección de vencimientos.