

Fecha de Publicación: 11 de Enero de 2007
Fecha de Información: 9 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\$158,7 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de 1,8%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero		Sector Real		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	30,0	11,5	4,5	23,0	34,6
15-35	79,8	45,6	32,1	66,3	111,9
36-60	4,9	2,4	2,4	4,9	7,2
61-90	2,0	0,3	0,3	2,0	2,3
91-180	0,2	1,5	1,5	0,2	1,7
>180	0,0	0,9	0,9	0,0	0,9
Total	116,9	62,2	41,7	96,4	158,7

* Cifras en millones de dólares

Cuadro No. 2
Devaluación Implícita Anualizada

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

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

Sector	8 al 12 de Enero				15 al 19 de Enero				22 al 26 de Enero			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Financiero	155	45	704	631	109	24	912	852	27	23	565	668
Real	45	155	475	549	24	109	658	718	23	27	519	415
Total	200	200	1179	1179	132	132	1570	1570	50	50	1084	1084

* Cifras en millones de dólares

¹ Datos provisionales.

² La fórmula para la devaluación implícita es: ((Tasa Pactada/Promedio SET FX) ^ (365/Plazo)) - 1

³ A partir del 10 de enero se presenta la proyección de vencimientos.