

Fecha de Publicación: 12 de Enero de 2007
Fecha de Información: 10 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\$436,8 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de 4,7%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

| Rango | Sector Financiero | | Sector Real | | Total |
|--------------|-------------------|--------------|--------------|--------------|--------------|
| | Compras | Ventas | Compras | Ventas | |
| 3-14 | 56,8 | 14,8 | 14,3 | 56,3 | 71,1 |
| 15-35 | 118,0 | 265,2 | 231,2 | 84,0 | 349,2 |
| 36-60 | 2,8 | 0,1 | 0,1 | 2,8 | 3,0 |
| 61-90 | 4,8 | 4,8 | 4,8 | 4,8 | 9,6 |
| 91-180 | 2,0 | 0,3 | 0,3 | 2,0 | 2,3 |
| >180 | 1,6 | 0,0 | 0,0 | 1,6 | 1,7 |
| Total | 186,1 | 285,2 | 250,7 | 151,6 | 436,8 |

* Cifras en millones de dólares

Cuadro No. 2
Devaluación Implícita Anualizada

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

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 | 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 | 46 | 705 | 630 | 120 | 24 | 956 | 867 | 27 | 23 | 576 | 675 |
| Real | 46 | 155 | 475 | 549 | 24 | 120 | 673 | 762 | 23 | 27 | 525 | 425 |
| Total | 200 | 200 | 1180 | 1180 | 144 | 144 | 1629 | 1629 | 50 | 50 | 1100 | 1100 |

* 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 11 de enero se presenta la proyección de vencimientos.