

Fecha de Publicación: 15 de Enero de 2007
Fecha de Información: 11 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\$530,0 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de 4,4%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero		Sector Real		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	78,2	74,2	36,7	40,7	114,8
15-35	155,4	236,8	209,8	128,4	365,2
36-60	9,1	6,0	6,0	9,1	15,1
61-90	12,8	3,2	3,2	12,8	16,0
91-180	1,4	6,6	6,6	1,4	8,0
>180	0,0	10,9	10,9	0,0	10,9
Total	256,9	337,6	273,1	192,4	530,0

* Cifras en millones de dólares

Cuadro No. 2
Devaluación Implícita Anualizada

Rango	Promedio Simple	Promedio Ponderado por Monto
3-14	6,8 %	7,3 %
15-35	3,5 %	3,6 %
36-60	3,3 %	3,4 %
61-90	2,2 %	2,6 %
91-180	3,5 %	3,9 %
>180	3,2 %	3,5 %
Total	3,9 %	4,4 %

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	25	996	905	38	23	632	790
Real	46	155	475	549	25	120	701	792	23	38	585	427
Total	200	200	1180	1180	145	145	1697	1697	61	61	1217	1217

* 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 12 de enero se presenta la proyección de vencimientos.