

Fecha de Publicación: 16 de Enero de 2007
Fecha de Información: 12 de Enero de 2007¹

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Según el reporte de los Intermediarios del Mercado Cambiario durante el día se pactó un total de US\$266,4 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de 1,9%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero		Sector Real		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	16,4	21,5	21,5	16,4	37,9
15-35	121,6	39,9	32,9	114,6	154,5
36-60	16,0	0,4	0,4	16,0	16,5
61-90	1,3	1,9	1,9	1,3	3,2
91-180	14,3	35,8	33,8	12,3	48,1
>180	0,0	6,2	6,2	0,0	6,2
Total	169,6	105,8	96,8	160,6	266,4

* Cifras en millones de dólares

Cuadro No. 2
Devaluación Implícita Anualizada

Rango	Promedio Simple	Promedio Ponderado por Monto
3-14	-0,6 %	-1,9 %
15-35	3,0 %	2,5 %
36-60	2,8 %	2,8 %
61-90	2,5 %	2,6 %
91-180	3,1 %	2,7 %
>180	3,1 %	3,1 %
Total	2,2 %	1,9 %

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	154	45	706	630	126	25	1006	922	38	23	633	744
Real	45	154	475	550	25	126	718	802	23	38	539	428
Total	199	199	1181	1181	151	151	1724	1724	61	61	1173	1173

* 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 15 de enero se presenta la proyección de vencimientos.