

Fecha de Publicación: 17 de Enero de 2007
Fecha de Información: 15 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\$190,7 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de 3,4%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero		Sector Real		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	13,8	14,5	14,5	13,8	28,3
15-35	109,8	3,1	3,1	109,8	112,9
36-60	10,0	2,1	2,1	10,0	12,1
61-90	0,3	2,5	2,5	0,3	2,8
91-180	12,0	5,4	3,4	10,0	15,4
>180	10,0	9,2	9,2	10,0	19,2
Total	155,9	36,9	34,9	153,9	190,7

* Cifras en millones de dólares

Cuadro No. 2
Devaluación Implícita Anualizada

Rango	Promedio Simple	Promedio Ponderado por Monto
3-14	14,5 %	11,0 %
15-35	4,0 %	1,4 %
36-60	5,4 %	7,4 %
61-90	3,3 %	2,1 %
91-180	2,5 %	2,6 %
>180	2,8 %	2,6 %
Total	5,6 %	3,4 %

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

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 16 de enero se presenta la proyección de vencimientos.

Cuadro No. 3
Vencimientos de Forwards

Sector	15 al 19 de Enero				22 al 26 de Enero				29 de Ene. al 2 de Febrero			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Financiero	126	25	1008	925	38	23	643	798	22	34	736	435
Real	25	126	721	804	23	38	593	438	34	22	342	643
Total	151	151	1728	1728	61	61	1236	1236	57	57	1078	1078

* Cifras en millones de dólares