

Fecha de Publicación: 30 de Enero de 2007
 Fecha de Información: 26 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\$458,9 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	53,1	55,8	15,8	13,1	69,0
15-35	195,9	147,1	115,5	164,3	311,3
36-60	5,6	5,2	5,2	5,6	10,7
61-90	8,1	0,9	0,9	8,1	8,9
91-180	5,4	6,7	1,7	0,4	7,1
>180	0,9	50,9	50,9	0,9	51,8
Total	269,0	266,6	190,0	192,4	458,9

* Cifras en millones de dólares

Cuadro No. 2
Devaluación Implícita Anualizada

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

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: $((Tasa\ Pactada / Promedio\ SET\ FX) ^ (365 / Plazo)) - 1$

³ A partir del 29 de enero se presenta la proyección de vencimientos.

Cuadro No. 3
Vencimientos de Forwards

Sector	22 al 26 de Enero				29 de Ene. al 2 de Febrero				5 al 9 de Febrero			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Financiero	72	25	738	858	42	37	909	584	25	20	705	671
Real	25	72	635	515	37	42	446	772	20	25	528	562
Total	97	97	1373	1373	79	79	1356	1356	45	45	1232	1232

* Cifras en millones de dólares