

Fecha de Publicación: 31 de Enero de 2007
 Fecha de Información: 29 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\$276,7 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de 1,6%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero		Sector Real		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	54,6	79,8	59,8	34,6	114,3
15-35	76,9	85,3	37,8	29,4	114,7
36-60	28,1	6,6	0,1	21,6	28,2
61-90	10,1	17,8	7,8	0,1	17,9
91-180	0,3	1,4	1,4	0,3	1,6
>180	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
Total	169,9	190,8	106,8	85,9	276,7

* Cifras en millones de dólares

Cuadro No. 2
Devaluación Implícita Anualizada

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

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 30 de enero se presenta la proyección de vencimientos.

Cuadro No. 3
Vencimientos de Forwards

Sector	29 de Ene. al 2 de Febrero				5 al 9 de Febrero				12 al 16 de Febrero			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Financiero	42	30	941	595	25	20	726	746	32	27	740	700
Real	30	42	458	804	20	25	583	563	27	32	560	600
Total	72	72	1399	1399	45	45	1308	1308	60	60	1300	1300

* Cifras en millones de dólares