

Fecha de Publicación: 1 de Febrero de 2007

Fecha de Información: 30 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\$233,4 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de 3,0%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero		Sector Real		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	6,0	11,1	11,1	6,0	17,1
15-35	97,9	50,1	45,1	92,9	143,0
36-60	30,1	2,6	2,6	30,1	32,7
61-90	0,0	3,7	3,7	0,0	3,7
91-180	0,9	3,5	3,5	0,9	4,4
>180	0,0	32,4	32,4	0,0	32,4
Total	134,9	103,4	98,4	129,9	233,4

* Cifras en millones de dólares

Cuadro No. 2
Devaluación Implícita Anualizada

Rango	Promedio Simple	Promedio Ponderado por Monto
3-14	8,9 %	6,3 %
15-35	2,8 %	2,8 %
36-60	3,6 %	1,9 %
61-90	3,1 %	3,0 %
91-180	3,4 %	2,7 %
>180	3,2 %	3,3 %
Total	4,0 %	3,0 %

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 31 de enero se presenta la proyección de vencimientos.

Cuadro No. 3
Vencimientos de Forwards

Sectores	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	29	942	600	25	21	731	752	32	28	761	716
Real	29	42	462	805	21	25	589	568	28	32	576	621
Total	71	71	1404	1404	46	46	1320	1320	60	60	1337	1337

* Cifras en millones de dólares