

Fecha de Publicación: 2 de Febrero de 2007

Fecha de Información: 31 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\$189,7 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de 1,2%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero		Sector Real		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	11,2	18,5	18,5	11,2	29,7
15-35	70,3	77,4	67,4	60,3	137,7
36-60	0,2	0,3	0,3	0,2	0,5
61-90	0,0	1,2	1,2	0,0	1,2
91-180	0,6	20,0	20,0	0,6	20,6
>180	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
Total	82,4	117,3	107,3	72,4	189,7

* Cifras en millones de dólares

Cuadro No. 2
Devaluación Implícita Anualizada

Rango	Promedio Simple	Promedio Ponderado por Monto
3-14	2,5 %	0,7 %
15-35	1,7 %	1,0 %
36-60	1,9 %	2,1 %
61-90	2,4 %	2,7 %
91-180	2,9 %	2,7 %
>180	2,8 %	2,8 %
Total	2,2 %	1,2 %

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 1 de febrero 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	43	28	943	601	25	21	738	766	33	28	765	766
Real	28	43	464	805	21	25	603	575	28	33	626	625
Total	71	71	1407	1407	46	46	1341	1341	60	60	1391	1391

* Cifras en millones de dólares