

Fecha de Publicación: 12 de Diciembre de 2006
Fecha de Información: 7 de Diciembre de 2006 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\$158,4 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de 5,3%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero		Sector Real		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	24,4	46,0	36,0	14,4	60,4
15-35	29,1	22,7	15,7	22,1	44,8
36-60	37,2	11,9	1,9	27,2	39,1
61-90	6,4	5,8	5,8	6,4	12,2
91-180	0,0	1,3	1,3	0,0	1,3
>180	0,2	0,4	0,4	0,2	0,6
Total	97,4	88,1	61,1	70,4	158,4

* Cifras en millones de dólares

Cuadro No. 2
Devaluación Implícita Anualizada

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

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

Cuadro No. 3
Vencimientos de Forwards

Sectores	4 al 8 de Diciembre				11 al 15 de Diciembre				18 al 22 de Diciembre			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Financiero	84	12	450	472	114	30	668	636	107	26	548	655
Real	12	84	387	365	30	114	506	537	26	107	436	330
Total	96	96	837	837	144	144	1174	1174	132	132	984	984

* Cifras en millones de dólares

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 8 de diciembre se presenta la proyección de vencimientos.