

Fecha de Publicación: 14 de Diciembre de 2006
Fecha de Información: 12 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\$258,2 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de 3,2%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero		Sector Real		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	56,8	30,7	25,6	51,7	82,4
15-35	104,2	59,4	46,0	90,8	150,2
36-60	0,2	0,4	0,4	0,2	0,6
61-90	0,0	1,8	1,8	0,0	1,8
91-180	0,4	2,8	2,8	0,4	3,2
>180	10,1	10,0	10,0	10,1	20,1
Total	171,7	105,0	86,5	153,2	258,2

* Cifras en millones de dólares

Cuadro No. 2
Devaluación Implícita Anualizada

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

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

Sector	11 al 15 de Diciembre				18 al 22 de Diciembre				25 al 29 de Diciembre			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Financiero	115	30	673	635	128	27	604	709	32	21	427	433
Real	30	115	510	548	27	128	484	379	21	32	288	282
Total	144	144	1183	1183	155	155	1088	1088	53	53	715	715

* 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 13 de diciembre se presenta la proyección de vencimientos.