

Fecha de Publicación: 18 de Diciembre de 2006
Fecha de Información: 14 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\$329,6 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de 3,6%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero		Sector Real		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	19,5	32,7	32,7	19,5	52,2
15-35	64,8	70,7	57,7	51,8	122,5
36-60	8,0	60,3	60,3	8,0	68,3
61-90	0,0	8,0	8,0	0,0	8,0
91-180	0,0	4,5	4,5	0,0	4,5
>180	60,1	13,9	13,9	60,1	74,1
Total	152,4	190,2	177,2	139,4	329,6

* Cifras en millones de dólares

Cuadro No. 2
Devaluación Implícita Anualizada

Rango	Promedio Simple	Promedio Ponderado por Monto
3-14	4,0 %	4,7 %
15-35	3,3 %	3,4 %
36-60	3,1 %	3,3 %
61-90	3,8 %	3,1 %
91-180	3,7 %	3,5 %
>180	3,4 %	3,3 %
Total	3,6 %	3,6 %

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	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	121	30	667	635	168	28	640	749	33	23	453	457
Real	30	121	510	542	28	168	514	405	22	32	303	298
Total	150	150	1177	1177	196	196	1154	1154	55	55	755	755

* 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 15 de diciembre se presenta la proyección de vencimientos.