

Fecha de Publicación: 20 de Diciembre de 2006
Fecha de Información: 18 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\$462,6 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de 3,8%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero		Sector Real		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	44,8	48,7	12,7	8,8	57,5
15-35	187,3	157,2	95,2	125,3	282,6
36-60	0,4	82,0	82,0	0,4	82,4
61-90	0,0	7,6	7,6	0,0	7,6
91-180	0,4	10,7	10,7	0,4	11,1
>180	7,1	14,3	14,3	7,1	21,4
Total	240,1	320,5	222,5	142,1	462,6

* Cifras en millones de dólares

Cuadro No. 2
Devaluación Implícita Anualizada

Rango	Promedio Simple	Promedio Ponderado por Monto
3-14	5,2 %	9,7 %
15-35	3,3 %	3,1 %
36-60	3,6 %	2,6 %
61-90	3,7 %	3,7 %
91-180	3,5 %	3,5 %
>180	3,2 %	3,3 %
Total	3,7 %	3,8 %

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	18 al 22 de Diciembre				25 al 29 de Diciembre				1 al 5 de Enero			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Financiero	169	29	678	792	38	23	477	509	14	13	397	326
Real	29	169	529	415	23	38	346	314	13	14	235	306
Total	198	198	1207	1207	61	61	823	823	27	27	632	632

* 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 19 de diciembre se presenta la proyección de vencimientos.