

Fecha de Publicación: 26 de Diciembre de 2006
Fecha de Información: 21 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\$319,0 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de 3,5%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero		Sector Real		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	127,5	59,6	9,6	77,5	137,1
15-35	74,1	101,5	79,5	52,1	153,6
36-60	3,0	6,8	6,8	3,0	9,8
61-90	3,2	3,7	3,7	3,2	6,9
91-180	2,7	6,8	6,8	2,7	9,4
>180	0,0	2,3	2,3	0,0	2,3
Total	210,4	180,7	108,7	138,4	319,0

* Cifras en millones de dólares

Cuadro No. 2
Devaluación Implícita Anualizada

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

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	170	30	677	812	37	33	607	563	53	13	524	452
Real	30	170	549	415	33	36	365	409	13	53	276	348
Total	200	200	1226	1226	69	69	972	972	66	66	800	800

* 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 22 de diciembre se presenta la proyección de vencimientos.