

Fecha de Publicación: 27 de Diciembre de 2006
Fecha de Información: 22 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\$338,0 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de 2,6%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero		Sector Real		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	77,8	54,1	35,1	58,8	112,9
15-35	97,8	111,2	89,2	75,8	187,0
36-60	16,5	0,8	0,8	16,5	17,3
61-90	3,9	0,3	0,3	3,9	4,2
91-180	0,1	16,5	16,5	0,1	16,6
>180	0,0	0,1	0,1	0,0	0,1
Total	196,0	183,0	142,0	155,0	338,0

* Cifras en millones de dólares

Cuadro No. 2
Devaluación Implícita Anualizada

Rango	Promedio Simple	Promedio Ponderado por Monto
3-14	3,1 %	2,1 %
15-35	3,1 %	3,0 %
36-60	3,6 %	1,4 %
61-90	3,8 %	2,9 %
91-180	3,7 %	3,3 %
>180	3,3 %	3,3 %
Total	3,3 %	2,6 %

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	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	42	34	639	579	53	13	564	490
Real	30	170	549	415	33	41	377	437	13	53	299	373
Total	200	200	1226	1226	74	74	1016	1016	67	67	863	863

* 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 25 de diciembre se presenta la proyección de vencimientos.