

Fecha de Publicación: 28 de Diciembre de 2006
Fecha de Información: 26 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\$241,1 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de 3,1%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero		Sector Real		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	22,4	6,2	6,2	22,4	28,6
15-35	77,9	178,9	111,9	10,9	189,8
36-60	0,0	2,8	2,8	0,0	2,8
61-90	0,0	2,5	2,5	0,0	2,5
91-180	1,9	2,9	2,9	1,9	4,9
>180	6,0	6,5	6,5	6,0	12,5
Total	108,2	199,9	132,9	41,2	241,1

* Cifras en millones de dólares

Cuadro No. 2
Devaluación Implícita Anualizada

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

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	25 al 29 de Diciembre				8 al 12 de Enero				1 al 5 de Enero			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Financiero	42	33	639	579	91	19	595	539	55	13	570	492
Real	33	41	377	437	19	91	418	474	13	55	301	379
Total	74	74	1017	1017	109	109	1013	1013	68	68	871	871

* Cifras en millones de dólares

¹ Datos provisionales.

² La fórmula para la devaluación implícita es: ((Tasa Pactada/Promedio SET FX) ^ (365/Plazo)) - 1

³ A partir del 27 de diciembre se presenta la proyección de vencimientos.