

Fecha de Publicación: 2 de Enero de 2007
Fecha de Información: 27 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\$282,8 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de 2,0%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero		Sector Real		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	52,1	22,8	2,8	32,1	54,9
15-35	61,7	165,8	125,8	21,7	187,5
36-60	14,1	1,6	1,6	14,1	15,7
61-90	0,0	1,9	1,9	0,0	1,9
91-180	7,8	3,5	3,5	7,8	11,2
>180	3,0	8,5	8,5	3,0	11,6
Total	138,8	204,0	144,0	78,8	282,8

* Cifras en millones de dólares

Cuadro No. 2
Devaluación Implícita Anualizada

Rango	Promedio Simple	Promedio Ponderado por Monto
3-14	2,5 %	2,4 %
15-35	2,3 %	1,5 %
36-60	4,1 %	4,3 %
61-90	3,5 %	4,0 %
91-180	3,3 %	2,3 %
>180	3,0 %	3,3 %
Total	2,8 %	2,0 %

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				1 al 5 de Enero				8 al 12 de Enero			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Financiero	41	32	639	580	55	13	593	514	92	19	624	540
Real	32	41	379	437	13	55	303	382	19	92	419	504
Total	73	73	1017	1017	68	68	896	896	111	111	1044	1044

* 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 28 de diciembre se presenta la proyección de vencimientos.