

Fecha de Publicación: 5 de Diciembre de 2006
Fecha de Información: 1 de Diciembre de 2006¹

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Según el reporte de los Intermediarios del Mercado Cambiario durante el día se pactó un total de US\$253,6 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de 1,5%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero		Sector Real		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	30,7	29,9	19,9	20,7	50,5
15-35	50,5	87,2	87,2	50,5	137,7
36-60	30,1	17,7	17,7	30,1	47,8
61-90	2,0	2,5	2,5	2,0	4,5
91-180	3,3	5,2	5,2	3,3	8,5
>180	0,3	4,3	4,3	0,3	4,6
Total	116,8	146,8	136,8	106,8	253,6

* Cifras en millones de dólares

Cuadro No. 2
Devaluación Implícita Anualizada

Rango	Promedio Simple	Promedio Ponderado por Monto
3-14	-2,0 %	0,6 %
15-35	2,1 %	1,7 %
36-60	1,3 %	1,2 %
61-90	2,2 %	2,5 %
91-180	2,5 %	2,8 %
>180	2,9 %	2,8 %
Total	1,4 %	1,5 %

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	27 de Nov. al 1 de Diciembre				4 al 8 de Diciembre				11 al 15 de Diciembre			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Financiero	70	23	722	661	84	10	449	472	95	27	573	509
Real	23	70	519	579	10	84	387	364	27	95	422	486
Total	92	92	1240	1240	94	94	836	836	122	122	996	996

* 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 4 de diciembre se presenta la proyección de vencimientos.