

Fecha de Publicación: 6 de Diciembre de 2006
Fecha de Información: 4 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\$179,2 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	41,8	18,7	10,7	33,8	52,5
15-35	65,7	48,6	35,1	52,2	100,8
36-60	0,2	10,3	10,3	0,2	10,5
61-90	0,0	1,0	1,0	0,0	1,0
91-180	3,1	8,5	8,5	3,1	11,5
>180	1,3	1,6	1,6	1,3	2,9
Total	112,0	88,7	67,2	90,5	179,2

* Cifras en millones de dólares

Cuadro No. 2
Devaluación Implícita Anualizada

Rango	Promedio Simple	Promedio Ponderado por Monto
3-14	3,8 %	-0,5 %
15-35	3,1 %	3,0 %
36-60	3,1 %	3,5 %
61-90	4,1 %	4,5 %
91-180	3,1 %	3,0 %
>180	2,8 %	3,0 %
Total	3,3 %	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	4 al 8 de Diciembre				11 al 15 de Diciembre				18 al 22 de Diciembre			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Financiero	85	10	449	473	97	27	612	527	105	25	437	475
Real	10	85	388	364	27	97	432	517	25	105	357	320
Total	95	95	837	837	124	124	1044	1044	130	130	794	794

* 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 5 de diciembre se presenta la proyección de vencimientos.