

Fecha de Publicación: 7 de Diciembre de 2006
Fecha de Información: 5 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\$318,6 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de 3,6%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero		Sector Real		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	67,4	121,7	71,6	17,3	138,9
15-35	89,4	62,5	27,5	54,4	116,9
36-60	26,4	2,2	2,2	26,4	28,6
61-90	2,3	10,9	10,9	2,3	13,2
91-180	2,0	5,2	5,2	2,0	7,1
>180	0,6	13,3	13,3	0,6	13,8
Total	188,0	215,7	130,6	102,9	318,6

* Cifras en millones de dólares

Cuadro No. 2
Devaluación Implícita Anualizada

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

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	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	84	10	450	473	102	29	659	624	106	26	462	510
Real	10	84	388	364	29	102	494	529	26	106	368	320
Total	95	95	837	837	131	131	1153	1153	131	131	830	830

* 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 6 de diciembre se presenta la proyección de vencimientos.