

Fecha de Publicación: 9 de Noviembre de 2006
Fecha de Información: 7 de Noviembre 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\$337,4 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de 2,9%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero		Sector Real		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	3,3	38,1	38,1	3,3	41,3
15-35	42,2	90,0	66,0	18,2	108,2
36-60	106,8	0,4	0,4	106,8	107,2
61-90	65,1	5,2	5,2	65,1	70,4
91-180	1,7	5,9	5,9	1,7	7,5
>180	0,3	2,5	2,5	0,3	2,8
Total	219,3	142,1	118,1	195,3	337,4

* Cifras en millones de dólares

Cuadro No. 2
Devaluación Implícita Anualizada

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

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

Sector	6 al 10 de Noviembre				13 al 17 de Noviembre				20 al 24 de Noviembre			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Financiero	54	24	486	446	53	16	476	364	64	15	306	255
Real	24	54	377	418	16	53	224	336	15	64	209	260
Total	78	78	864	864	69	69	701	701	79	79	515	515

* 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 8 de noviembre se presenta la proyección de vencimientos.