

Fecha de Publicación: 10 de Noviembre de 2006

Fecha de Información: 8 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\$244,8 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de 4,9%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero		Sector Real		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	42,4	58,2	23,1	7,3	65,5
15-35	79,9	60,0	50,0	69,9	129,9
36-60	0,3	0,4	0,4	0,3	0,8
61-90	30,3	2,7	2,7	30,3	33,0
91-180	1,4	6,0	5,0	0,4	6,4
>180	0,4	8,9	8,9	0,4	9,3
Total	154,6	136,3	90,2	108,5	244,8

* Cifras en millones de dólares

Cuadro No. 2
Devaluación Implícita Anualizada

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

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

Sectores	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	487	446	59	17	513	420	64	15	311	257
Real	24	54	377	418	17	59	245	338	15	64	211	265
Total	78	78	864	864	76	76	758	758	79	79	522	522

* 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 9 de noviembre se presenta la proyección de vencimientos.