

Fecha de Publicación: 14 de Noviembre de 2006

Fecha de Información: 9 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\$356,2 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de 1,4%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero		Sector Real		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	76,4	53,4	33,4	56,4	109,9
15-35	103,2	52,6	26,6	77,2	129,8
36-60	30,0	12,0	12,0	30,0	42,1
61-90	28,3	2,2	2,2	28,3	30,5
91-180	0,2	2,9	2,9	0,2	3,1
>180	1,3	39,6	39,6	1,3	40,9
Total	239,4	162,8	116,8	193,4	356,2

* Cifras en millones de dólares

Cuadro No. 2
Devaluación Implícita Anualizada

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

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	25	487	446	64	17	554	424	66	16	352	326
Real	25	54	378	418	17	64	249	379	16	66	260	286
Total	79	79	864	864	81	81	803	803	82	82	611	611

* 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 10 de noviembre se presenta la proyección de vencimientos.