

Fecha de Publicación: 16 de Noviembre de 2006
Fecha de Información: 14 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\$219,6 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de 2,2%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero		Sector Real		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	18,0	17,1	17,1	18,0	35,1
15-35	53,2	51,8	44,2	45,6	97,4
36-60	22,5	26,0	26,0	22,5	48,5
61-90	9,1	8,5	8,5	9,1	17,6
91-180	0,4	18,7	18,7	0,4	19,1
>180	0,4	1,6	1,6	0,4	2,0
Total	103,6	123,7	116,1	96,0	219,6

* Cifras en millones de dólares

Cuadro No. 2
Devaluación Implícita Anualizada

Rango	Promedio Simple	Promedio Ponderado por Monto
3-14	0,6 %	1,6 %
15-35	2,0 %	1,9 %
36-60	2,4 %	2,6 %
61-90	2,7 %	2,3 %
91-180	3,0 %	3,2 %
>180	3,0 %	3,0 %
Total	2,3 %	2,2 %

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	13 al 17 de Noviembre				20 al 24 de Noviembre				27 de Nov. al 1 de Diciembre			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Financiero	66	17	588	478	71	17	361	347	61	22	533	417
Real	17	66	303	413	17	71	281	295	22	61	308	424
Total	82	82	891	891	87	87	642	642	84	84	841	841

* 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 15 de noviembre se presenta la proyección de vencimientos.