

Fecha de Publicación: 17 de Noviembre de 2006
Fecha de Información: 15 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\$176,2 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de 2,4%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero		Sector Real		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	20,1	20,2	15,1	15,0	35,1
15-35	64,2	58,0	53,0	59,2	117,2
36-60	3,0	2,1	2,1	3,0	5,1
61-90	3,7	3,3	3,3	3,7	7,0
91-180	0,2	6,8	6,8	0,2	7,0
>180	0,5	4,3	4,3	0,5	4,8
Total	91,7	94,7	84,6	81,6	176,2

* Cifras en millones de dólares

Cuadro No. 2
Devaluación Implícita Anualizada

Rango	Promedio Simple	Promedio Ponderado por Monto
3-14	1,7 %	0,2 %
15-35	2,6 %	3,0 %
36-60	2,8 %	2,1 %
61-90	3,4 %	2,7 %
91-180	3,5 %	3,2 %
>180	3,3 %	3,1 %
Total	2,9 %	2,4 %

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

Sector	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	592	478	73	17	366	356	62	22	555	428
Real	17	66	303	417	17	73	285	295	22	62	319	446
Total	82	82	895	895	89	89	651	651	85	85	874	874

* 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 16 de noviembre se presenta la proyección de vencimientos.