

Fecha de Publicación: 24 de Noviembre de 2006
Fecha de Información: 22 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\$380,4 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de 4,2%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero		Sector Real		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	18,2	103,6	103,1	17,7	121,2
15-35	69,9	83,0	83,0	69,9	153,0
36-60	3,8	44,4	44,4	3,8	48,2
61-90	15,8	0,8	0,8	15,8	16,6
91-180	30,1	3,0	3,0	30,1	33,1
>180	0,1	8,2	8,2	0,1	8,3
Total	137,8	243,0	242,5	137,3	380,4

* Cifras en millones de dólares

Cuadro No. 2
Devaluación Implícita Anualizada

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

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	20 al 24 de Noviembre				27 de Nov. al 1 de Diciembre				4 al 8 de Diciembre			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Financiero	77	27	422	374	65	23	625	576	76	9	350	316
Real	27	77	292	341	23	65	445	494	9	76	267	301
Total	105	105	715	715	88	88	1070	1070	85	85	617	617

* 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 23 de noviembre se presenta la proyección de vencimientos.