

Fecha de Publicación: 20 de Noviembre de 2006
Fecha de Información: 16 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\$337,5 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de 3,4%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero		Sector Real		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	56,9	32,4	32,4	56,9	89,2
15-35	78,2	75,4	55,4	58,2	133,7
36-60	1,0	61,3	61,3	1,0	62,3
61-90	0,7	26,8	26,8	0,7	27,5
91-180	20,7	3,0	3,0	20,7	23,7
>180	0,8	0,3	0,3	0,8	1,1
Total	158,3	199,2	179,2	138,3	337,5

* Cifras en millones de dólares

Cuadro No. 2
Devaluación Implícita Anualizada

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

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	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	65	17	592	478	75	23	406	365	63	22	572	445
Real	17	65	303	417	23	75	294	335	22	63	336	462
Total	82	82	894	894	98	98	700	700	85	85	908	908

* 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 17 de noviembre se presenta la proyección de vencimientos.