

Fecha de Publicación: 21 de Noviembre de 2006
Fecha de Información: 17 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\$332,7 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de 2,5%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero		Sector Real		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	23,9	39,1	23,1	7,9	47,0
15-35	63,0	61,6	61,1	62,5	124,0
36-60	54,0	7,3	7,3	54,0	61,3
61-90	63,8	6,0	6,0	63,8	69,8
91-180	20,5	6,2	6,2	20,5	26,7
>180	1,1	2,8	2,8	1,1	3,8
Total	226,3	122,9	106,4	209,8	332,7

* Cifras en millones de dólares

Cuadro No. 2
Devaluación Implícita Anualizada

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

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	16	592	479	76	26	408	365	63	22	593	482
Real	16	65	303	417	26	76	294	336	22	63	356	468
Total	81	81	895	895	102	102	702	702	85	85	950	950

* 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 20 de noviembre se presenta la proyección de vencimientos.