

Fecha de Publicación: 22 de Noviembre de 2006
Fecha de Información: 20 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\$183,5 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de 3,9%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero		Sector Real		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	23,8	26,0	11,0	8,8	34,8
15-35	63,7	31,5	16,5	48,7	80,2
36-60	5,0	31,4	31,4	5,0	36,4
61-90	29,0	2,0	2,0	29,0	31,0
91-180	0,5	0,3	0,3	0,5	0,9
>180	0,1	0,1	0,1	0,1	0,2
Total	122,2	91,3	61,3	92,2	183,5

* Cifras en millones de dólares

Cuadro No. 2
Devaluación Implícita Anualizada

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

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	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	64	22	600	493	76	9	332	273
Real	27	77	292	341	22	64	367	475	9	76	224	283
Total	104	104	715	715	87	87	967	967	85	85	556	556

* 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 21 de noviembre se presenta la proyección de vencimientos.