

Fecha de Publicación: 23 de Noviembre de 2006
Fecha de Información: 21 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\$266,3 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de 1,9%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero		Sector Real		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	21,1	23,0	17,9	16,0	39,1
15-35	79,0	115,9	108,9	72,0	187,9
36-60	22,1	6,1	6,1	22,1	28,2
61-90	0,0	1,3	1,3	0,0	1,3
91-180	2,0	5,1	5,1	2,0	7,2
>180	0,3	2,3	2,3	0,3	2,6
Total	124,6	153,8	141,7	112,5	266,3

* 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	2,4 %	2,2 %
36-60	2,5 %	1,2 %
61-90	4,0 %	3,7 %
91-180	2,7 %	2,7 %
>180	3,2 %	3,2 %
Total	2,5 %	1,9 %

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

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	64	23	618	515	76	9	337	273
Real	27	77	292	341	23	64	385	487	9	76	224	287
Total	104	104	715	715	87	87	1003	1003	85	85	561	561

* Cifras en millones de dólares

¹ Datos provisionales.

² La fórmula para la devaluación implícita es: ((Tasa Pactada/Promedio SET FX) ^ (365/Plazo)) - 1

³ A partir del 22 de noviembre se presenta la proyección de vencimientos.