

Fecha de Publicación: 27 de Noviembre de 2006
Fecha de Información: 23 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\$142,9 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de 3,1%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero		Sector Real		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	13,1	34,9	34,9	13,1	48,0
15-35	10,1	22,6	17,6	5,1	27,7
36-60	1,6	28,3	28,3	1,6	29,9
61-90	23,7	5,9	5,9	23,7	29,6
91-180	0,5	2,4	2,4	0,5	2,8
>180	0,3	4,5	4,5	0,3	4,8
Total	49,3	98,6	93,6	44,3	142,9

* Cifras en millones de dólares

Cuadro No. 2
Devaluación Implícita Anualizada

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

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	423	374	67	23	628	586	77	9	358	342
Real	27	77	292	342	23	67	455	497	9	77	292	309
Total	104	104	715	715	89	89	1083	1083	86	86	650	650

* 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 24 de noviembre se presenta la proyección de vencimientos.