

Fecha de Publicación: 28 de Noviembre de 2006
Fecha de Información: 24 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\$183,9 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de 2,8%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero		Sector Real		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	25,6	40,0	35,0	20,6	60,6
15-35	52,8	44,3	39,3	47,8	92,1
36-60	9,4	1,1	1,1	9,4	10,4
61-90	1,8	0,2	0,2	1,8	1,9
91-180	1,4	4,8	4,8	1,4	6,1
>180	3,5	9,2	9,2	3,5	12,7
Total	94,3	99,5	89,5	84,3	183,9

* Cifras en millones de dólares

Cuadro No. 2
Devaluación Implícita Anualizada

Rango	Promedio Simple	Promedio Ponderado por Monto
3-14	0,4 %	3,9 %
15-35	2,2 %	2,1 %
36-60	2,5 %	2,7 %
61-90	2,5 %	2,4 %
91-180	2,6 %	3,1 %
>180	2,8 %	2,9 %
Total	1,9 %	2,8 %

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	24	642	610	77	9	368	356
Real	27	77	293	342	24	67	479	512	9	77	302	314
Total	104	104	716	716	91	91	1122	1122	86	86	670	670

* 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 27 de noviembre se presenta la proyección de vencimientos.