

Fecha de Publicación: 29 de Noviembre de 2006
Fecha de Información: 27 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\$399,4 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de 4,3%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero		Sector Real		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	105,7	72,0	29,0	62,7	134,7
15-35	129,3	141,9	89,9	77,3	219,2
36-60	7,5	11,9	11,9	7,5	19,4
61-90	9,1	0,2	0,2	9,1	9,3
91-180	4,4	2,4	2,4	4,4	6,8
>180	5,5	4,6	4,6	5,5	10,1
Total	261,5	233,0	138,0	166,5	399,4

* Cifras en millones de dólares

Cuadro No. 2
Devaluación Implícita Anualizada

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

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	27 de Nov. al 1 de Diciembre				4 al 8 de Diciembre				11 al 15 de Diciembre			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Financiero	69	24	713	643	81	9	398	390	78	25	494	405
Real	24	69	500	570	9	81	310	317	25	78	334	424
Total	93	93	1213	1213	91	91	707	707	103	103	829	829

* 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 28 de noviembre se presenta la proyección de vencimientos.