

Fecha de Publicación: 4 de Octubre de 2006
Fecha de Información: 2 de Octubre de 2006¹

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Según el reporte de los Intermediarios del Mercado Cambiario durante el día se pactó un total de US\$227,7 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de 6,2%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero		Sector Real		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	16,2	38,2	24,2	2,2	40,4
15-35	62,5	48,8	32,8	46,5	95,2
36-60	25,6	6,3	6,3	25,6	31,9
61-90	3,8	3,0	3,0	3,8	6,7
91-180	10,0	15,6	15,6	10,0	25,6
>180	0,0	27,8	27,8	0,0	27,8
Total	118,1	139,6	109,6	88,1	227,7

* Cifras en millones de dólares

Cuadro No. 2
Devaluación Implícita Anualizada

Rango	Promedio Simple	Promedio Ponderado por Monto
3-14	5,3 %	18,3 %
15-35	3,5 %	3,4 %
36-60	3,8 %	4,3 %
61-90	3,3 %	3,2 %
91-180	3,6 %	3,3 %
>180	3,5 %	3,5 %
Total	4,0 %	6,2 %

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	2 al 6 de Octubre				9 al 13 de Octubre				16 al 20 de Octubre			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Financiero	191	21	572	526	34	21	511	467	11	14	517	357
Real	21	191	365	411	21	34	353	397	14	11	269	428
Total	212	212	937	937	55	55	864	864	24	24	785	785

* 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 3 de octubre se presenta la proyección de vencimientos.