

Fecha de Publicación: 6 de Octubre de 2006
Fecha de Información: 4 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\$217,1 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de 2,4%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero		Sector Real		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	65,1	50,0	14,0	29,1	79,1
15-35	46,6	65,0	55,0	36,6	101,6
36-60	0,5	0,0	0,0	0,5	0,5
61-90	1,2	0,0	0,0	1,2	1,2
91-180	34,5	0,0	0,0	34,5	34,5
>180	0,0	0,1	0,1	0,0	0,1
Total	147,8	115,2	69,2	101,8	217,1

* Cifras en millones de dólares

Cuadro No. 2
Devaluación Implícita Anualizada

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

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	198	21	568	529	38	22	557	508	11	14	554	390
Real	21	198	367	407	22	38	365	414	14	11	283	448
Total	219	219	935	935	59	59	922	922	25	25	838	838

* 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 5 de octubre se presenta la proyección de vencimientos.