

Fecha de Publicación: 12 de Octubre de 2006
Fecha de Información: 10 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\$221,5 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	32,2	27,8	4,7	9,1	36,9
15-35	85,7	23,9	18,9	80,7	104,6
36-60	7,5	0,9	0,9	7,5	8,4
61-90	7,7	1,0	1,0	7,7	8,6
91-180	10,0	47,4	47,4	10,0	57,4
>180	5,5	5,1	0,1	0,5	5,6
Total	148,5	106,1	73,0	115,4	221,5

* Cifras en millones de dólares

Cuadro No. 2
Devaluación Implícita Anualizada

Rango	Promedio Simple	Promedio Ponderado por Monto
3-14	3,9 %	4,5 %
15-35	3,4 %	2,6 %
36-60	3,5 %	2,8 %
61-90	3,2 %	2,9 %
91-180	3,3 %	3,3 %
>180	3,3 %	3,1 %
Total	3,5 %	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	9 al 13 de Octubre				16 al 20 de Octubre				23 al 27 de Octubre			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Financiero	41	26	624	583	12	15	632	438	23	12	649	501
Real	26	41	381	422	15	12	296	491	12	23	412	559
Total	66	66	1005	1005	27	27	928	928	35	35	1061	1061

* 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 11 de octubre se presenta la proyección de vencimientos.