

Fecha de Publicación: 18 de Octubre de 2006
Fecha de Información: 13 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\$323,1 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	54,5	20,4	20,4	54,5	74,9
15-35	52,0	59,4	57,4	50,0	109,4
36-60	11,0	27,8	27,8	11,0	38,8
61-90	9,1	34,3	34,3	9,0	43,4
91-180	1,0	29,6	29,6	1,0	30,6
>180	7,7	20,3	18,3	5,7	26,0
Total	135,2	191,8	187,8	131,2	323,1

* Cifras en millones de dólares

Cuadro No. 2
Devaluación Implícita Anualizada

Rango	Promedio Simple	Promedio Ponderado por Monto
3-14	4,0 %	-0,1 %
15-35	3,5 %	2,6 %
36-60	3,7 %	3,7 %
61-90	3,6 %	3,7 %
91-180	3,4 %	3,4 %
>180	3,4 %	3,3 %
Total	3,6 %	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	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	40	26	625	595	14	17	707	507	25	16	724	566
Real	26	40	393	423	17	14	326	525	16	25	472	629
Total	66	66	1018	1018	31	31	1033	1033	41	41	1196	1196

* 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 16 de octubre se presenta la proyección de vencimientos.