

Fecha de Publicación: 20 de Octubre de 2006
Fecha de Información: 18 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\$356,5 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de 1,6%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero		Sector Real		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	89,0	80,3	45,2	53,9	134,2
15-35	121,2	49,4	37,4	109,2	158,6
36-60	0,3	6,5	6,5	0,3	6,8
61-90	1,3	16,8	16,8	1,3	18,0
91-180	2,0	15,6	15,6	2,0	17,6
>180	19,0	2,2	2,2	19,0	21,2
Total	232,8	170,8	123,7	185,7	356,5

* Cifras en millones de dólares

Cuadro No. 2
Devaluación Implícita Anualizada

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

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	16 al 20 de Octubre				23 al 27 de Octubre				30 de Oct. al 3 de Noviembre			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Financiero	14	18	710	507	25	17	798	621	19	22	718	587
Real	18	14	326	529	17	25	488	666	22	19	528	659
Total	32	32	1036	1036	41	41	1286	1286	41	41	1246	1246

* 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 19 de octubre se presenta la proyección de vencimientos.