

Fecha de Publicación: 23 de Octubre de 2006
Fecha de Información: 19 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\$309,2 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de 4,4%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero		Sector Real		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	44,3	62,0	40,0	22,3	84,3
15-35	122,6	25,7	8,6	105,4	131,2
36-60	32,3	9,8	9,8	32,3	42,1
61-90	8,5	21,1	21,1	8,5	29,7
91-180	0,4	5,7	5,5	0,2	5,9
>180	11,1	15,8	5,0	0,3	16,1
Total	219,2	140,1	90,0	169,1	309,2

* Cifras en millones de dólares

Cuadro No. 2
Devaluación Implícita Anualizada

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

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	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	15	19	710	507	25	17	828	676	20	22	732	594
Real	19	15	325	529	17	25	521	674	22	20	535	673
Total	33	33	1035	1035	42	42	1350	1350	42	42	1267	1267

* 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 20 de octubre se presenta la proyección de vencimientos.