

Fecha de Publicación: 24 de Octubre de 2006
Fecha de Información: 20 de Octubre de 2006 ¹

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Según el reporte de los Intermediarios del Mercado Cambiario durante el día se pactó un total de US\$347,0 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de 4,3%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero		Sector Real		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	54,8	146,6	96,6	4,8	151,4
15-35	62,3	48,0	26,0	40,3	88,3
36-60	71,2	1,6	1,6	71,2	72,7
61-90	16,1	1,2	1,2	16,1	17,3
91-180	12,1	3,2	3,2	12,1	15,3
>180	1,0	0,9	0,9	1,0	1,9
Total	217,4	201,5	129,5	145,4	347,0

* Cifras en millones de dólares

Cuadro No. 2
Devaluación Implícita Anualizada

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

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	22	710	504	26	16	839	695	19	23	776	721
Real	22	15	322	529	16	26	531	674	23	19	622	677
Total	36	36	1032	1032	42	42	1370	1370	42	42	1398	1398

* 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 23 de octubre se presenta la proyección de vencimientos.