

Fecha de Publicación: 25 de Octubre de 2006
Fecha de Información: 23 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\$236,2 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de 2,9%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero		Sector Real		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	14,3	32,5	32,5	14,3	46,8
15-35	70,9	31,1	31,1	70,9	102,0
36-60	17,4	4,2	4,2	17,4	21,6
61-90	30,4	5,0	5,0	30,4	35,5
91-180	20,5	2,9	2,9	20,5	23,4
>180	3,9	3,0	3,0	3,9	6,9
Total	157,4	78,7	78,7	157,4	236,2

* Cifras en millones de dólares

Cuadro No. 2
Devaluación Implícita Anualizada

Rango	Promedio Simple	Promedio Ponderado por Monto
3-14	0,2 %	2,9 %
15-35	2,6 %	2,9 %
36-60	2,8 %	3,9 %
61-90	2,7 %	2,7 %
91-180	2,8 %	2,3 %
>180	3,1 %	3,2 %
Total	2,2 %	2,9 %

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	23 al 27 de Octubre				30 de Oct. al 3 de Noviembre				6 al 10 de Noviembre			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Financiero	29	16	852	710	19	23	774	739	46	19	301	216
Real	16	29	545	687	23	19	640	675	19	46	193	279
Total	45	45	1397	1397	42	42	1414	1414	65	65	495	495

* 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 24 de octubre se presenta la proyección de vencimientos.