

Fecha de Publicación: 26 de Octubre de 2006
Fecha de Información: 24 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\$213,0 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de 3,2%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero		Sector Real		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	32,9	13,1	13,1	32,9	46,0
15-35	35,1	28,1	22,1	29,1	57,2
36-60	23,7	0,6	0,6	23,7	24,3
61-90	37,1	27,1	21,1	31,1	58,2
91-180	1,6	11,8	11,8	1,6	13,4
>180	6,1	7,7	7,7	6,1	13,8
Total	136,5	88,5	76,5	124,5	213,0

* Cifras en millones de dólares

Cuadro No. 2
Devaluación Implícita Anualizada

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

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

Sector	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	30	16	851	710	23	23	802	752	47	19	307	220
Real	16	30	545	687	23	23	653	703	19	47	197	284
Total	45	45	1397	1397	47	47	1455	1455	66	66	504	504

* 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 25 de octubre se presenta la proyección de vencimientos.