

Fecha de Publicación: 27 de Octubre de 2006
Fecha de Información: 25 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\$203,3 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de 2,8%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero		Sector Real		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	66,0	93,7	48,6	20,9	114,6
15-35	18,5	6,8	6,8	18,5	25,3
36-60	5,0	0,5	0,5	5,0	5,6
61-90	22,2	21,1	21,1	22,2	43,3
91-180	0,1	8,2	8,2	0,1	8,3
>180	5,2	0,9	0,9	5,2	6,2
Total	117,1	131,2	86,1	72,0	203,3

* Cifras en millones de dólares

Cuadro No. 2
Devaluación Implícita Anualizada

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

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	30	16	851	710	23	23	856	804	48	19	318	264
Real	16	30	545	687	23	23	670	722	19	48	231	285
Total	46	46	1397	1397	47	47	1527	1527	67	67	549	549

* 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 26 de octubre se presenta la proyección de vencimientos.