

Fecha de Publicación: 1 de Noviembre de 2006
Fecha de Información: 30 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\$269,1 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de 2,5%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero		Sector Real		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	17,0	69,0	63,9	11,9	81,0
15-35	72,3	24,1	16,0	64,2	88,3
36-60	40,0	0,8	0,4	39,6	40,4
61-90	2,8	0,7	0,7	2,8	3,5
91-180	1,9	6,5	5,9	1,3	7,8
>180	7,2	46,0	41,0	2,2	48,2
Total	141,2	147,1	127,9	122,0	269,1

* Cifras en millones de dólares

Cuadro No. 2
Devaluación Implícita Anualizada

Rango	Promedio Simple	Promedio Ponderado por Monto
3-14	3,4 %	1,4 %
15-35	2,7 %	2,9 %
36-60	3,1 %	3,1 %
61-90	3,5 %	3,0 %
91-180	3,0 %	3,1 %
>180	3,2 %	3,1 %
Total	3,1 %	2,5 %

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	30 de Oct. al 3 de Noviembre				6 al 10 de Noviembre				13 al 17 de Noviembre			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Financiero	24	24	898	895	52	23	403	348	38	16	394	274
Real	24	24	739	742	23	52	295	350	16	38	183	304
Total	48	48	1638	1638	74	74	698	698	54	54	578	578

* Cifras en millones de dólares

¹ Datos provisionales.

² La fórmula para la devaluación implícita es: ((Tasa Pactada/Promedio SET FX) ^ (365/Plazo)) - 1

³ A partir del 31 de octubre se presenta la proyección de vencimientos.