

Fecha de Publicación: 2 de Noviembre de 2006

Fecha de Información: 31 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\$312,7 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de 2,4%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero		Sector Real		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	26,2	27,0	25,5	24,7	51,8
15-35	87,7	79,7	67,7	75,7	155,4
36-60	60,0	11,6	11,6	60,0	71,5
61-90	1,0	9,7	9,7	1,0	10,8
91-180	17,1	4,6	4,5	17,1	21,7
>180	0,0	1,6	1,6	0,0	1,6
Total	192,1	134,2	120,7	178,5	312,7

* Cifras en millones de dólares

Cuadro No. 2
Devaluación Implícita Anualizada

Rango	Promedio Simple	Promedio Ponderado por Monto
3-14	0,2 %	1,7 %
15-35	2,0 %	2,5 %
36-60	2,1 %	2,4 %
61-90	2,9 %	3,0 %
91-180	2,8 %	2,5 %
>180	3,2 %	3,2 %
Total	1,9 %	2,4 %

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	26	23	913	897	52	24	409	365	38	16	404	285
Real	23	26	741	757	24	52	313	356	16	38	191	309
Total	49	49	1654	1654	76	76	722	722	54	54	595	595

* 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 1 de noviembre se presenta la proyección de vencimientos.