

Fecha de Publicación: 3 de Noviembre de 2006
Fecha de Información: 1 de Noviembre 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\$278,5 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de 3,0%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero		Sector Real		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	52,7	14,4	4,4	42,7	57,2
15-35	95,6	116,5	81,5	60,6	177,1
36-60	6,4	3,7	3,7	6,4	10,1
61-90	12,5	0,5	0,5	12,5	13,0
91-180	12,3	7,9	7,9	12,3	20,2
>180	0,2	0,8	0,8	0,2	0,9
Total	179,6	143,8	98,8	134,6	278,5

* Cifras en millones de dólares

Cuadro No. 2
Devaluación Implícita Anualizada

Rango	Promedio Simple	Promedio Ponderado por Monto
3-14	2,1 %	4,5 %
15-35	2,7 %	2,6 %
36-60	3,2 %	3,0 %
61-90	2,7 %	2,5 %
91-180	1,8 %	2,6 %
>180	3,1 %	3,3 %
Total	2,4 %	3,0 %

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	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	914	897	55	24	432	366	40	16	430	299
Real	23	26	741	758	24	55	314	379	16	40	195	326
Total	49	49	1655	1655	79	79	746	746	56	56	625	625

* 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 2 de noviembre se presenta la proyección de vencimientos.