

Fecha de Publicación: 27 de Septiembre de 2006
Fecha de Información: 25 de Septiembre 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\$274,7 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de 1,6%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero		Sector Real		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	97,0	50,6	50,6	97,0	147,6
15-35	72,9	55,7	46,7	63,9	119,7
36-60	0,3	5,1	5,1	0,3	5,4
61-90	0,9	0,2	0,2	0,9	1,1
91-180	0,7	0,2	0,2	0,7	0,9
>180	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
Total	171,9	111,8	102,8	162,9	274,7

* Cifras en millones de dólares

Cuadro No. 2
Devaluación Implícita Anualizada

Rango	Promedio Simple	Promedio Ponderado por Monto
3-14	2,8 %	0,9 %
15-35	2,4 %	2,4 %
36-60	2,7 %	3,8 %
61-90	3,2 %	2,9 %
91-180	3,0 %	2,9 %
>180	-	-
Total	2,6 %	1,6 %

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	25 al 29 de Septiembre				2 al 6 de Octubre				9 al 13 de Octubre			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Financiero	14	21	982	991	126	19	469	389	28	15	433	379
Real	21	14	837	828	19	126	302	383	15	28	312	366
Total	35	35	1819	1819	145	145	771	771	43	43	746	746

* 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 septiembre se presenta la proyección de vencimientos.