

Fecha de Publicación: 28 de Septiembre de 2006
Fecha de Información: 26 de Septiembre 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\$298,2 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de 4,6%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero		Sector Real		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	130,5	63,2	28,1	95,4	158,6
15-35	80,8	46,9	30,9	64,8	111,6
36-60	15,7	4,4	4,4	15,7	20,2
61-90	0,6	1,1	1,1	0,6	1,7
91-180	2,1	1,7	1,7	2,1	3,8
>180	2,3	2,1	0,1	0,3	2,4
Total	232,0	119,3	66,2	178,9	298,2

* Cifras en millones de dólares

Cuadro No. 2
Devaluación Implícita Anualizada

Rango	Promedio Simple	Promedio Ponderado por Monto
3-14	2,9 %	6,0 %
15-35	3,0 %	3,0 %
36-60	3,2 %	3,5 %
61-90	3,2 %	3,3 %
91-180	3,2 %	3,0 %
>180	3,1 %	2,9 %
Total	3,1 %	4,6 %

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	20	1002	1014	170	19	529	429	28	15	450	383
Real	20	14	860	848	19	170	307	407	15	28	316	383
Total	34	34	1862	1862	189	189	836	836	43	43	766	766

* 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 27 de septiembre se presenta la proyección de vencimientos.