

Fecha de Publicación: 2 de Octubre de 2006
Fecha de Información: 28 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\$319,5 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de 3,5%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero		Sector Real		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	55,1	48,6	15,6	22,1	70,7
15-35	111,2	90,4	63,9	84,7	175,1
36-60	5,5	0,9	0,9	5,5	6,4
61-90	16,9	6,8	6,8	16,9	23,7
91-180	0,1	41,8	41,8	0,1	41,9
>180	0,3	1,5	1,5	0,3	1,8
Total	189,1	190,0	130,5	129,6	319,5

* Cifras en millones de dólares

Cuadro No. 2
Devaluación Implícita Anualizada

Rango	Promedio Simple	Promedio Ponderado por Monto
3-14	3,4 %	4,8 %
15-35	2,5 %	3,1 %
36-60	3,2 %	3,0 %
61-90	3,1 %	3,3 %
91-180	3,2 %	3,0 %
>180	2,8 %	3,6 %
Total	2,9 %	3,5 %

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	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	12	21	1004	1015	188	19	548	483	30	20	509	459
Real	21	12	861	850	19	188	345	410	20	30	345	395
Total	32	32	1865	1865	208	208	893	893	50	50	854	854

* 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 29 de septiembre se presenta la proyección de vencimientos.