

Fecha de Publicación: 3 de Octubre de 2006
Fecha de Información: 29 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\$248,6 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de 3,1%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero		Sector Real		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	16,7	16,0	6,0	6,7	22,6
15-35	112,9	91,0	64,0	85,9	176,8
36-60	9,4	3,9	3,9	9,4	13,3
61-90	0,1	2,6	2,6	0,1	2,7
91-180	2,6	20,3	20,2	2,5	22,8
>180	0,0	10,4	10,4	0,0	10,4
Total	141,6	144,1	107,0	104,5	248,6

* Cifras en millones de dólares

Cuadro No. 2
Devaluación Implícita Anualizada

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

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	20	1004	1016	189	19	558	493	34	20	511	464
Real	20	12	862	850	19	189	346	411	20	34	350	397
Total	31	31	1866	1866	208	208	904	904	54	54	861	861

* 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 octubre se presenta la proyección de vencimientos.