

Fecha de Publicación: 13 de Septiembre de 2006
Fecha de Información: 11 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\$431,0 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de 2,5%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero		Sector Real		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	82,7	54,3	14,3	42,7	97,0
15-35	93,9	40,7	33,7	86,9	127,6
36-60	12,5	74,1	74,1	12,5	86,6
61-90	2,5	50,7	50,7	2,5	53,2
91-180	6,7	43,5	43,5	6,7	50,2
>180	16,5	0,0	0,0	16,5	16,5
Total	214,9	263,2	216,2	167,9	431,0

* Cifras en millones de dólares

Cuadro No. 2
Devaluación Implícita Anualizada

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

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	11 al 15 de Septiembre				18 al 22 de Septiembre				25 al 29 de Septiembre			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Financiero	24	18	921	834	7	16	716	726	6	19	699	744
Real	18	24	642	729	16	7	502	492	19	6	629	584
Total	42	42	1563	1563	23	23	1218	1218	25	25	1328	1328

* 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 12 de septiembre se presenta la proyección de vencimientos.