

Fecha de Publicación: 15 de Septiembre de 2006
Fecha de Información: 13 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\$441,7 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	56,5	63,4	22,4	15,5	78,9
15-35	195,6	95,3	65,3	165,6	260,9
36-60	17,1	0,1	0,1	17,1	17,3
61-90	30,3	8,0	1,0	23,3	31,3
91-180	10,8	40,5	40,4	10,7	51,2
>180	0,0	2,1	2,1	0,0	2,1
Total	310,3	209,5	131,4	232,3	441,7

* Cifras en millones de dólares

Cuadro No. 2
Devaluación Implícita Anualizada

Rango	Promedio Simple	Promedio Ponderado por Monto
3-14	1,5 %	1,9 %
15-35	2,9 %	2,7 %
36-60	1,0 %	0,9 %
61-90	2,2 %	1,8 %
91-180	1,7 %	2,9 %
>180	3,6 %	3,8 %
Total	2,2 %	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	25	18	922	835	8	17	793	797	6	19	753	784
Real	18	25	642	730	17	8	532	528	19	6	669	638
Total	43	43	1564	1564	24	24	1325	1325	25	25	1422	1422

* Cifras en millones de dólares

¹ Datos provisionales.

² La fórmula para la devaluación implícita es: ((Tasa Pactada/Promedio SET FX) ^ (365/Plazo)) - 1

³ A partir del 14 de septiembre se presenta la proyección de vencimientos.