

Fecha de Publicación: 20 de Septiembre de 2006
Fecha de Información: 18 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\$233,5 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de 10,3%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero		Sector Real		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	89,3	62,6	36,6	63,3	125,8
15-35	30,5	69,7	69,7	30,5	100,2
36-60	0,2	0,3	0,3	0,2	0,5
61-90	5,3	0,6	0,6	5,3	5,9
91-180	0,0	1,2	1,2	0,0	1,2
>180	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
Total	125,2	134,3	108,3	99,2	233,5

* Cifras en millones de dólares

Cuadro No. 2
Devaluación Implícita Anualizada

Rango	Promedio Simple	Promedio Ponderado por Monto
3-14	8,1 %	15,6 %
15-35	3,3 %	4,3 %
36-60	3,0 %	3,3 %
61-90	3,0 %	2,6 %
91-180	3,8 %	3,8 %
>180	-	-
Total	5,0 %	10,3 %

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	18 al 22 de Septiembre				25 al 29 de Septiembre				2 al 6 de Octubre			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Financiero	9	17	876	905	11	21	833	855	8	18	405	326
Real	17	9	618	589	21	11	726	704	18	8	239	319
Total	26	26	1494	1494	32	32	1559	1559	27	27	644	644

* 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 19 de septiembre se presenta la proyección de vencimientos.