

Fecha de Publicación: 21 de Septiembre de 2006
Fecha de Información: 19 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\$252,9 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de 2,7%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero		Sector Real		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	44,8	9,1	4,0	39,7	48,8
15-35	108,8	68,9	57,9	97,8	166,7
36-60	19,0	15,3	4,3	8,0	23,3
61-90	7,3	0,3	0,3	7,3	7,7
91-180	5,1	1,3	1,3	5,1	6,4
>180	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
Total	185,1	94,9	67,8	158,0	252,9

* Cifras en millones de dólares

Cuadro No. 2
Devaluación Implícita Anualizada

Rango	Promedio Simple	Promedio Ponderado por Monto
3-14	3,7 %	3,6 %
15-35	2,6 %	2,6 %
36-60	2,8 %	1,7 %
61-90	3,3 %	2,1 %
91-180	3,2 %	2,8 %
>180	-	-
Total	3,0 %	2,7 %

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

Sector	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	18	876	905	11	21	877	864	10	18	410	326
Real	18	9	618	589	21	11	730	743	18	10	240	324
Total	27	27	1494	1494	32	32	1607	1607	28	28	650	650

* 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 20 de septiembre se presenta la proyección de vencimientos.