

Fecha de Publicación: 22 de Septiembre de 2006
Fecha de Información: 20 de Septiembre de 2006¹

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Según el reporte de los Intermediarios del Mercado Cambiario durante el día se pactó un total de US\$232,2 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de 2,2%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero		Sector Real		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	42,1	50,4	30,4	22,1	72,6
15-35	83,9	10,5	10,5	83,9	94,4
36-60	29,8	0,0	0,0	29,8	29,8
61-90	5,2	1,3	1,3	5,2	6,6
91-180	1,3	0,3	0,2	1,3	1,6
>180	5,3	22,0	22,0	5,3	27,3
Total	167,7	84,5	64,5	147,6	232,2

* Cifras en millones de dólares

Cuadro No. 2
Devaluación Implícita Anualizada

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

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	22	876	902	12	20	917	913	10	18	411	327
Real	22	9	615	589	20	12	759	763	18	10	241	325
Total	31	31	1491	1491	32	32	1676	1676	29	29	652	652

* 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 21 de septiembre se presenta la proyección de vencimientos.