

Fecha de Publicación: 25 de Septiembre de 2006
Fecha de Información: 21 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\$395,6 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de 3,4%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero		Sector Real		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	98,7	39,7	39,7	98,7	138,4
15-35	61,8	187,1	156,1	30,8	217,8
36-60	1,2	7,2	7,2	1,2	8,4
61-90	4,8	1,1	1,1	4,8	5,9
91-180	1,8	2,0	2,0	1,8	3,7
>180	5,3	15,9	15,9	5,3	21,2
Total	173,6	253,0	222,0	142,6	395,6

* Cifras en millones de dólares

Cuadro No. 2
Devaluación Implícita Anualizada

Rango	Promedio Simple	Promedio Ponderado por Monto
3-14	5,6 %	4,6 %
15-35	2,7 %	2,7 %
36-60	2,6 %	2,6 %
61-90	2,4 %	2,7 %
91-180	2,2 %	2,3 %
>180	2,6 %	3,1 %
Total	3,6 %	3,4 %

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	13	19	941	938	50	18	445	343
Real	22	9	615	589	19	13	783	787	18	50	257	359
Total	31	31	1491	1491	32	32	1725	1725	69	69	702	702

* 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 22 de septiembre se presenta la proyección de vencimientos.