

Fecha de Publicación: 31 de Agosto de 2006
Fecha de Información: 29 de Agosto 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\$428,1 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de 2,0%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero		Sector Real		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	113,2	57,7	13,7	69,2	126,9
15-35	104,9	102,3	98,3	100,9	203,2
36-60	0,0	15,6	15,6	0,0	15,6
61-90	0,1	17,1	17,1	0,1	17,3
91-180	25,1	5,1	5,1	25,1	30,3
>180	32,8	2,0	2,0	32,8	34,8
Total	276,3	199,8	151,8	228,3	428,1

* Cifras en millones de dólares

Cuadro No. 2
Devaluación Implícita Anualizada

Rango	Promedio Simple	Promedio Ponderado por Monto
3-14	4,6 %	1,3 %
15-35	2,0 %	2,3 %
36-60	3,0 %	3,3 %
61-90	2,7 %	2,0 %
91-180	3,5 %	1,5 %
>180	2,7 %	2,8 %
Total	2,8 %	2,0 %

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	28 de Ago. al 1 de Septiembre				4 al 8 de Septiembre				11 al 15 de Septiembre			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Financiero	26	24	1003	790	14	15	545	477	16	17	583	609
Real	24	26	500	713	15	14	355	423	17	16	540	515
Total	50	50	1503	1503	29	29	900	900	33	33	1124	1124

* 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 30 de agosto se presenta la proyección de vencimientos.