

Fecha de Publicación: 4 de Septiembre de 2006

Fecha de Información: 31 de Agosto 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\$156,8 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de 3,0%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero		Sector Real		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	45,3	17,0	0,0	28,3	45,3
15-35	76,5	39,0	26,0	63,5	102,5
36-60	0,2	0,0	0,0	0,2	0,2
61-90	0,3	0,5	0,5	0,3	0,8
91-180	0,0	7,1	7,1	0,0	7,1
>180	1,0	0,0	0,0	1,0	1,0
Total	123,2	63,6	33,6	93,2	156,8

* Cifras en millones de dólares

Cuadro No. 2
Devaluación Implícita Anualizada

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

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	27	23	1022	808	15	16	587	504	16	17	661	635
Real	23	27	518	732	16	15	367	450	17	16	544	571
Total	50	50	1540	1540	31	31	954	954	33	33	1206	1206

* 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 1 de septiembre se presenta la proyección de vencimientos.