

Fecha de Publicación: 7 de Septiembre de 2006
Fecha de Información: 5 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\$179,0 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de 3,1%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero		Sector Real		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	18,8	19,7	14,6	13,7	33,4
15-35	59,3	91,7	81,7	49,3	140,9
36-60	0,0	1,0	1,0	0,0	1,0
61-90	0,2	0,5	0,5	0,2	0,7
91-180	0,6	0,5	0,5	0,6	1,1
>180	0,0	1,9	1,9	0,0	1,9
Total	78,8	115,3	100,2	63,7	179,0

* Cifras en millones de dólares

Cuadro No. 2
Devaluación Implícita Anualizada

Rango	Promedio Simple	Promedio Ponderado por Monto
3-14	4,7 %	2,9 %
15-35	3,5 %	3,2 %
36-60	2,9 %	3,4 %
61-90	2,9 %	2,7 %
91-180	3,6 %	3,7 %
>180	3,6 %	3,5 %
Total	3,8 %	3,1 %

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	4 al 8 de Septiembre				11 al 15 de Septiembre				18 al 22 de Septiembre			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Financiero	15	18	610	546	19	17	777	709	5	16	621	598
Real	18	15	392	456	17	19	598	666	16	5	452	476
Total	33	33	1002	1002	36	36	1375	1375	21	21	1073	1073

* 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 6 de septiembre se presenta la proyección de vencimientos.