

Fecha de Publicación: 11 de Septiembre de 2006
Fecha de Información: 7 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\$261,4 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de 1,8%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero		Sector Real		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	76,7	72,0	21,0	25,7	97,7
15-35	58,1	64,2	59,2	53,1	117,3
36-60	5,1	18,1	18,1	5,1	23,1
61-90	1,0	21,8	21,8	1,0	22,8
91-180	0,1	0,4	0,4	0,1	0,4
>180	0,2	0,0	0,0	0,2	0,2
Total	141,1	176,4	120,4	85,1	261,4

* Cifras en millones de dólares

Cuadro No. 2
Devaluación Implícita Anualizada

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

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	609	546	20	18	899	809	5	16	667	662
Real	18	15	392	456	18	20	629	719	16	5	477	482
Total	33	33	1002	1002	38	38	1528	1528	21	21	1144	1144

* 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 8 de septiembre se presenta la proyección de vencimientos.