

Fecha de Publicación: 12 de Septiembre de 2006
Fecha de Información: 8 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\$184,2 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de 1,5%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero		Sector Real		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	15,7	34,7	23,7	4,7	39,3
15-35	90,9	66,8	44,8	68,9	135,7
36-60	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
61-90	0,5	1,7	1,7	0,5	2,2
91-180	0,5	6,4	6,4	0,5	6,9
>180	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
Total	107,6	109,6	76,6	74,6	184,2

* Cifras en millones de dólares

Cuadro No. 2
Devaluación Implícita Anualizada

Rango	Promedio Simple	Promedio Ponderado por Monto
3-14	3,5 %	1,6 %
15-35	2,3 %	1,4 %
36-60	1,8 %	1,8 %
61-90	2,8 %	3,7 %
91-180	3,2 %	3,0 %
>180	-	-
Total	2,9 %	1,5 %

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	24	18	901	822	6	16	679	685
Real	18	15	392	456	18	24	641	720	16	6	488	483
Total	33	33	1002	1002	42	42	1542	1542	23	23	1167	1167

* 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 11 de septiembre se presenta la proyección de vencimientos.