

Fecha de Publicación: 2 de Agosto de 2006
Fecha de Información: 31 de Julio 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\$164,1 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de -0,9%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero		Sector Real		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	72,5	61,2	14,2	25,5	86,6
15-35	41,9	11,8	3,6	33,7	45,5
36-60	17,5	2,0	2,0	17,5	19,5
61-90	1,6	0,9	0,9	1,6	2,4
91-180	0,0	7,4	7,4	0,0	7,4
>180	0,0	2,6	2,6	0,0	2,6
Total	133,4	85,9	30,7	78,2	164,1

* Cifras en millones de dólares

Cuadro No. 2
Devaluación Implícita Anualizada

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

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	31 de Jul. al 4 de Agosto				7 al 11 de Agosto				14 al 18 de Agosto			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Financiero	8	30	526	475	5	39	428	443	9	66	331	415
Real	30	8	279	330	39	5	320	305	66	9	297	213
Total	37	37	805	805	44	44	748	748	75	75	628	628

* 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 1 de agosto se presenta la proyección de vencimientos.