

Fecha de Publicación: 3 de Agosto de 2006
Fecha de Información: 01 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\$181,8 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de 9,4%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero		Sector Real		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	26,8	27,6	8,6	7,8	35,4
15-35	64,6	86,2	65,2	43,6	129,8
36-60	4,9	0,2	0,2	4,9	5,1
61-90	0,7	0,7	0,7	0,7	1,4
91-180	1,4	0,4	0,4	1,4	1,8
>180	1,0	7,2	7,2	1,0	8,2
Total	99,4	122,3	82,3	59,4	181,8

* Cifras en millones de dólares

Cuadro No. 2
Devaluación Implícita Anualizada

Rango	Promedio Simple	Promedio Ponderado por Monto
3-14	14,3 %	31,4 %
15-35	2,9 %	4,2 %
36-60	2,0 %	3,1 %
61-90	1,2 %	1,8 %
91-180	3,1 %	2,9 %
>180	2,3 %	2,5 %
Total	5,2 %	9,4 %

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	545	494	6	39	431	452	9	66	335	444
Real	30	8	279	330	39	6	329	308	66	9	327	217
Total	38	38	824	824	45	45	760	760	75	75	661	661

* 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 2 de agosto se presenta la proyección de vencimientos.