

Fecha de Publicación: 8 de Agosto de 2006
Fecha de Información: 03 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\$516,1 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de 2,9%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero		Sector Real		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	31,4	22,0	22,0	31,4	53,3
15-35	138,8	120,9	106,9	124,8	245,8
36-60	56,2	10,0	10,0	56,2	66,2
61-90	24,2	28,5	28,5	24,2	52,7
91-180	21,3	42,2	42,2	21,3	63,5
>180	0,3	34,2	34,2	0,3	34,5
Total	272,3	257,8	243,8	258,3	516,1

* Cifras en millones de dólares

Cuadro No. 2
Devaluación Implícita Anualizada

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

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

Sector	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	9	30	544	493	17	40	482	503	14	66	357	486
Real	30	9	279	330	40	17	356	335	66	14	368	240
Total	39	39	823	823	57	57	838	838	80	80	725	725

* 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 4 de agosto se presenta la proyección de vencimientos.