

Fecha de Publicación: 9 de Agosto de 2006
Fecha de Información: 4 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\$205,5 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de 1,4%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero		Sector Real		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	5,5	4,7	4,7	5,5	10,3
15-35	37,2	37,8	34,7	34,1	71,9
36-60	63,1	3,8	3,8	63,1	66,9
61-90	24,0	3,5	3,5	24,0	27,5
91-180	2,3	17,9	17,9	2,3	20,2
>180	5,0	4,7	3,7	4,0	8,8
Total	137,2	72,4	68,3	133,1	205,5

* Cifras en millones de dólares

Cuadro No. 2
Devaluación Implícita Anualizada

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

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	11	30	542	493	18	40	486	507	17	66	358	487
Real	30	11	279	328	40	18	359	338	66	17	370	241
Total	41	41	821	821	58	58	845	845	84	84	728	728

* 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 7 de agosto se presenta la proyección de vencimientos.