

Fecha de Publicación: 10 de Agosto de 2006
Fecha de Información: 8 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\$282,6 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de 2,6%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero		Sector Real		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	26,3	14,9	13,9	25,3	40,2
15-35	85,1	67,2	43,2	61,1	128,3
36-60	67,3	48,5	35,5	54,3	102,8
61-90	2,3	6,1	6,1	2,3	8,3
91-180	1,5	1,5	1,5	1,5	2,9
>180	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
Total	182,4	138,2	100,2	144,4	282,6

* Cifras en millones de dólares

Cuadro No. 2
Devaluación Implícita Anualizada

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

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	7 al 11 de Agosto				14 al 18 de Agosto				21 al 25 de Agosto			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Financiero	18	40	486	507	18	66	381	499	4	60	593	559
Real	40	18	360	339	66	18	382	263	60	4	420	454
Total	58	58	846	846	84	84	763	763	64	64	1014	1014

* 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 9 de agosto se presenta la proyección de vencimientos.