

Fecha de Publicación: 11 de Agosto de 2006
Fecha de Información: 9 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\$366,9 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de 2,3%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero		Sector Real		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	81,7	38,8	38,8	81,7	120,5
15-35	86,0	93,1	85,0	77,9	171,0
36-60	12,2	3,5	3,5	12,2	15,7
61-90	0,8	3,5	3,5	0,8	4,3
91-180	0,4	52,4	52,4	0,4	52,8
>180	0,0	2,5	2,5	0,0	2,6
Total	181,2	193,8	185,7	173,1	366,9

* Cifras en millones de dólares

Cuadro No. 2
Devaluación Implícita Anualizada

Rango	Promedio Simple	Promedio Ponderado por Monto
3-14	-0,7 %	3,4 %
15-35	1,4 %	1,4 %
36-60	2,1 %	2,0 %
61-90	2,2 %	2,0 %
91-180	2,0 %	2,3 %
>180	2,3 %	2,4 %
Total	1,4 %	2,3 %

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	17	41	487	507	18	66	459	537	4	60	619	577
Real	41	17	360	340	66	18	419	342	60	4	430	472
Total	57	57	847	847	85	85	879	879	64	64	1050	1050

* 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 10 de agosto se presenta la proyección de vencimientos.