

Fecha de Publicación: 14 de Agosto de 2006
Fecha de Información: 10 de Agosto de 2006¹

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Según el reporte de los Intermediarios del Mercado Cambiario durante el día se pactó un total de US\$341,7 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de 0,9%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero		Sector Real		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	49,2	46,8	25,0	27,4	74,2
15-35	124,5	115,3	55,3	64,5	179,8
36-60	0,5	25,2	25,2	0,5	25,7
61-90	29,1	8,9	8,5	28,7	37,6
91-180	14,1	9,5	9,5	14,1	23,7
>180	0,0	0,8	0,8	0,0	0,8
Total	217,4	206,5	124,3	135,3	341,7

* Cifras en millones de dólares

Cuadro No. 2
Devaluación Implícita Anualizada

Rango	Promedio Simple	Promedio Ponderado por Monto
3-14	-2,0 %	2,5 %
15-35	2,2 %	0,1 %
36-60	2,3 %	1,7 %
61-90	1,8 %	0,5 %
91-180	1,9 %	0,6 %
>180	2,0 %	2,1 %
Total	1,3 %	0,9 %

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

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	24	487	524	19	66	464	556	4	60	686	626
Real	24	17	376	340	66	19	436	345	60	4	439	499
Total	41	41	864	864	86	86	900	900	64	64	1126	1126

* 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 11 de agosto se presenta la proyección de vencimientos.