

Fecha de Publicación: 15 de Agosto de 2006
Fecha de Información: 11 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\$279,4 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	41,3	57,3	52,1	36,1	93,4
15-35	90,3	97,9	48,9	41,3	139,3
36-60	13,2	1,4	1,4	13,2	14,6
61-90	0,7	0,2	0,2	0,7	0,8
91-180	0,2	21,9	21,9	0,2	22,1
>180	6,0	3,2	3,2	6,0	9,2
Total	151,7	182,0	127,8	97,4	279,4

* Cifras en millones de dólares

Cuadro No. 2
Devaluación Implícita Anualizada

Rango	Promedio Simple	Promedio Ponderado por Monto
3-14	2,8 %	0,1 %
15-35	2,0 %	1,1 %
36-60	2,4 %	1,3 %
61-90	2,4 %	2,6 %
91-180	2,9 %	2,4 %
>180	2,4 %	2,1 %
Total	2,5 %	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	20	56	477	603	5	60	713	648
Real	24	17	377	340	56	20	483	358	60	5	455	521
Total	41	41	864	864	75	75	961	961	65	65	1168	1168

* 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 14 de agosto se presenta la proyección de vencimientos.