

Fecha de Publicación: 16 de Agosto de 2006
Fecha de Información: 14 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\$172,7 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de 1,7%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero		Sector Real		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	24,7	18,6	16,6	22,7	41,3
15-35	44,1	37,5	37,5	44,1	81,6
36-60	3,6	35,9	35,9	3,6	39,5
61-90	4,1	0,5	0,5	4,1	4,6
91-180	0,9	1,1	1,1	0,9	2,0
>180	1,0	3,8	2,8	0,0	3,8
Total	78,4	97,3	94,3	75,4	172,7

* Cifras en millones de dólares

Cuadro No. 2
Devaluación Implícita Anualizada

Rango	Promedio Simple	Promedio Ponderado por Monto
3-14	4,0 %	-0,5 %
15-35	1,8 %	2,5 %
36-60	2,8 %	2,3 %
61-90	2,5 %	2,4 %
91-180	2,5 %	2,4 %
>180	2,4 %	2,3 %
Total	2,5 %	1,7 %

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	14 al 18 de Agosto				21 al 25 de Agosto				28 de Ago. al 1 de Septiembre			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Financiero	20	56	477	602	5	60	737	656	17	23	624	451
Real	56	20	483	358	60	5	462	543	23	17	283	456
Total	76	76	960	960	65	65	1199	1199	39	39	907	907

* 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 15 de agosto se presenta la proyección de vencimientos.