

Fecha de Publicación: 17 de Agosto de 2006
Fecha de Información: 15 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\$311,0 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 | 60,8 | 70,8 | 25,5 | 15,5 | 86,3 |
| 15-35 | 46,5 | 125,4 | 125,4 | 46,5 | 171,8 |
| 36-60 | 18,6 | 23,9 | 23,9 | 18,6 | 42,5 |
| 61-90 | 0,3 | 4,8 | 4,8 | 0,3 | 5,1 |
| 91-180 | 0,9 | 4,1 | 4,1 | 0,9 | 4,9 |
| >180 | 0,0 | 0,3 | 0,3 | 0,0 | 0,3 |
| Total | 127,1 | 229,2 | 183,9 | 81,8 | 311,0 |

* Cifras en millones de dólares

Cuadro No. 2
Devaluación Implícita Anualizada

| Rango | Promedio Simple | Promedio Ponderado por Monto |
|--------------|-----------------|------------------------------|
| 3-14 | 1,3 % | 3,7 % |
| 15-35 | 1,8 % | 1,7 % |
| 36-60 | 1,4 % | 1,8 % |
| 61-90 | 2,1 % | 2,2 % |
| 91-180 | 2,1 % | 2,3 % |
| >180 | 2,3 % | 2,3 % |
| Total | 1,8 % | 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 | 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 | 503 | 625 | 5 | 76 | 752 | 666 | 17 | 23 | 681 | 497 |
| Real | 56 | 20 | 483 | 360 | 76 | 5 | 469 | 556 | 23 | 17 | 309 | 492 |
| Total | 76 | 76 | 986 | 986 | 81 | 81 | 1222 | 1222 | 39 | 39 | 989 | 989 |

* Cifras en millones de dólares

¹ Datos provisionales.

² La fórmula para la devaluación implícita es: $((\text{Tasa Pactada}/\text{Promedio SET FX}) \wedge (365/\text{Plazo})) - 1$

³ A partir del 16 de agosto se presenta la proyección de vencimientos.