

Fecha de Publicación: 23 de Agosto de 2006
Fecha de Información: 18 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\$306,8 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	42,2	109,7	74,6	7,1	116,8
15-35	62,9	87,8	62,8	37,9	125,7
36-60	11,8	10,1	0,1	1,8	11,8
61-90	20,7	2,9	2,9	20,7	23,6
91-180	1,5	9,4	9,4	1,5	10,8
>180	0,5	17,5	17,5	0,5	18,0
Total	139,6	237,3	167,2	69,5	306,8

* Cifras en millones de dólares

Cuadro No. 2
Devaluación Implícita Anualizada

Rango	Promedio Simple	Promedio Ponderado por Monto
3-14	0,7 %	3,1 %
15-35	1,7 %	1,9 %
36-60	1,6 %	0,6 %
61-90	2,1 %	1,9 %
91-180	2,3 %	2,1 %
>180	2,4 %	2,3 %
Total	1,6 %	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

Sector	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	19	55	504	626	6	77	798	714	19	23	805	639
Real	55	19	484	361	77	6	513	597	23	19	415	581
Total	74	74	987	987	83	83	1311	1311	42	42	1220	1220

* 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 21 de agosto se presenta la proyección de vencimientos.