

Fecha de Publicación: 24 de Agosto de 2006
Fecha de Información: 22 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\$196,3 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de 1,8%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero		Sector Real		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	12,4	3,1	3,1	12,4	15,5
15-35	62,5	90,7	66,7	38,5	129,2
36-60	41,4	0,5	0,5	41,4	41,9
61-90	0,2	1,5	1,5	0,2	1,7
91-180	0,1	1,9	1,9	0,1	2,0
>180	5,0	5,9	0,9	0,0	5,9
Total	121,5	103,8	74,8	92,5	196,3

* Cifras en millones de dólares

Cuadro No. 2
Devaluación Implícita Anualizada

Rango	Promedio Simple	Promedio Ponderado por Monto
3-14	2,7 %	0,1 %
15-35	2,4 %	2,1 %
36-60	2,3 %	1,4 %
61-90	2,5 %	2,7 %
91-180	2,6 %	2,7 %
>180	2,7 %	2,9 %
Total	2,5 %	1,8 %

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	21 al 25 de Agosto				28 de Ago. al 1 de Septiembre				4 al 8 de Septiembre			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Financiero	7	77	798	715	21	23	816	641	9	15	381	306
Real	77	7	514	597	23	21	417	592	15	9	239	315
Total	83	83	1312	1312	44	44	1233	1233	24	24	620	620

* 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 23 de agosto se presenta la proyección de vencimientos.