

Fecha de Publicación: 25 de Agosto de 2006
Fecha de Información: 23 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\$424,3 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de 0,7%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero		Sector Real		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	75,0	17,1	17,1	75,0	92,1
15-35	186,1	144,7	90,7	132,1	276,8
36-60	0,5	10,4	10,4	0,5	10,9
61-90	3,4	12,9	12,9	3,4	16,3
91-180	0,0	1,1	1,1	0,0	1,1
>180	1,0	26,1	26,1	1,0	27,1
Total	266,1	212,2	158,2	212,1	424,3

* Cifras en millones de dólares

Cuadro No. 2
Devaluación Implícita Anualizada

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

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

Sector	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	76	799	716	24	23	863	659	12	15	421	308
Real	76	7	514	597	23	24	434	639	15	12	241	354
Total	83	83	1313	1313	46	46	1298	1298	28	28	662	662

* 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 24 de agosto se presenta la proyección de vencimientos.