

Fecha de Publicación: 28 de Agosto de 2006
Fecha de Información: 24 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\$364,2 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de 3,6%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero		Sector Real		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	36,8	72,5	59,8	24,0	96,5
15-35	121,6	113,7	88,6	96,5	210,2
36-60	1,3	8,2	8,1	1,3	9,4
61-90	4,4	4,7	4,7	4,4	9,1
91-180	21,5	22,2	2,2	1,5	23,8
>180	15,0	0,2	0,2	15,0	15,2
Total	200,7	221,5	163,6	142,8	364,2

* Cifras en millones de dólares

Cuadro No. 2
Devaluación Implícita Anualizada

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

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	76	799	716	25	23	889	675	13	15	435	364
Real	76	7	514	597	23	25	441	655	15	13	294	365
Total	83	83	1313	1313	48	48	1330	1330	29	29	729	729

* 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 25 de agosto se presenta la proyección de vencimientos.