

Fecha de Publicación: 29 de Agosto de 2006
Fecha de Información: 25 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\$335,9 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de 2,6%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero		Sector Real		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	67,1	73,1	46,1	40,1	113,3
15-35	106,8	91,4	78,4	93,8	185,3
36-60	3,7	1,1	1,1	3,7	4,9
61-90	4,6	25,3	25,3	4,6	30,0
91-180	2,5	0,1	0,1	2,5	2,6
>180	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
Total	184,8	191,1	151,1	144,8	335,9

* Cifras en millones de dólares

Cuadro No. 2
Devaluación Implícita Anualizada

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

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

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	26	23	924	710	14	15	465	403
Real	76	7	515	597	23	26	462	677	15	14	320	381
Total	83	83	1314	1314	50	50	1386	1386	29	29	784	784

* 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 28 de agosto se presenta la proyección de vencimientos.