

Fecha de Publicación: 13 de Julio de 2006
Fecha de Información: 11 de Julio 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\$271,4 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de -1,1%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero		Sector Real		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	66,3	32,8	22,8	56,3	89,2
15-35	65,8	100,0	77,2	43,0	143,0
36-60	9,6	0,6	0,6	9,6	10,2
61-90	0,1	0,1	0,1	0,1	0,2
91-180	2,1	13,8	13,8	2,1	15,9
>180	0,0	12,9	12,9	0,0	12,9
Total	144,0	160,2	127,4	111,2	271,4

* Cifras en millones de dólares

Cuadro No. 2
Devaluación Implícita Anualizada

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

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	10 al 14 de Julio				17 al 21 de Julio				24 al 28 de Julio			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Financiero	16	44	683	729	7	19	266	481	12	59	552	562
Real	44	16	408	362	19	7	392	177	59	12	367	357
Total	60	60	1091	1091	26	26	658	658	71	71	919	919

* 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 12 de julio se presenta la proyección de vencimientos.