

Fecha de Publicación: 17 de Julio de 2006
Fecha de Información: 13 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\$349,0 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de 1,5%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero		Sector Real		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	97,7	6,0	6,0	97,7	103,8
15-35	54,6	99,2	93,2	48,6	147,8
36-60	2,0	34,9	34,9	2,0	36,8
61-90	21,8	17,1	17,1	21,8	38,9
91-180	2,6	14,9	12,9	0,6	15,5
>180	0,0	6,2	6,2	0,0	6,2
Total	178,7	178,3	170,3	170,7	349,0

* Cifras en millones de dólares

Cuadro No. 2
Devaluación Implícita Anualizada

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

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	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	19	44	680	729	8	20	325	489	10	59	610	593
Real	44	19	408	359	20	8	399	235	59	10	385	402
Total	63	63	1088	1088	28	28	724	724	69	69	995	995

* 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 14 de julio se presenta la proyección de vencimientos.