

Fecha de Publicación: 18 de Julio de 2006
Fecha de Información: 14 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\$114,7 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de 2,7%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero		Sector Real		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	7,0	4,7	4,7	7,0	11,7
15-35	15,6	45,7	33,7	3,6	49,4
36-60	0,3	30,2	30,2	0,3	30,5
61-90	1,1	20,1	20,1	1,1	21,3
91-180	0,3	0,1	0,1	0,3	0,4
>180	1,0	0,5	0,5	1,0	1,5
Total	25,3	101,4	89,4	13,3	114,7

* Cifras en millones de dólares

Cuadro No. 2
Devaluación Implícita Anualizada

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

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

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	38	680	734	10	20	326	489	10	59	614	597
Real	38	19	413	359	20	10	400	237	59	10	390	407
Total	57	57	1093	1093	30	30	726	726	69	69	1004	1004

* 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 17 de julio se presenta la proyección de vencimientos.