

Fecha de Publicación: 21 de Julio de 2006
Fecha de Información: 18 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\$134,3 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de 3,5%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero		Sector Real		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	5,2	5,1	5,1	5,2	10,3
15-35	23,9	52,1	40,1	11,9	63,9
36-60	27,9	8,7	1,7	20,9	29,6
61-90	8,5	10,2	2,2	0,5	10,7
91-180	9,8	17,0	10,0	2,8	19,8
>180	0,1	0,0	0,0	0,1	0,1
Total	75,3	93,0	59,0	41,3	134,3

* Cifras en millones de dólares

Cuadro No. 2
Devaluación Implícita Anualizada

Rango	Promedio Simple	Promedio Ponderado por Monto
3-14	6,3 %	5,8 %
15-35	3,5 %	4,3 %
36-60	2,8 %	1,1 %
61-90	3,8 %	4,5 %
91-180	3,0 %	2,7 %
>180	2,9 %	2,9 %
Total	3,6 %	3,5 %

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	17 al 21 de Julio				24 al 28 de Julio				31 de Jul. al 4 de Agosto			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Financiero	10	20	332	494	11	60	629	638	3	29	344	310
Real	20	10	400	238	60	11	421	412	29	3	186	219
Total	31	31	732	732	71	71	1050	1050	32	32	530	530

* 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 19 de julio se presenta la proyección de vencimientos.