

Fecha de Publicación: 26 de Julio de 2006
Fecha de Información: 24 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\$285,4 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de 1,2%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero		Sector Real		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	8,5	17,7	12,2	3,0	20,7
15-35	147,9	104,0	69,0	112,9	216,9
36-60	0,0	11,1	11,1	0,0	11,1
61-90	0,0	3,1	3,1	0,0	3,1
91-180	7,1	6,0	6,0	7,1	13,1
>180	0,0	20,6	20,6	0,0	20,6
Total	163,5	162,4	121,9	123,0	285,4

* Cifras en millones de dólares

Cuadro No. 2
Devaluación Implícita Anualizada

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

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	24 al 28 de Julio				31 de Jul. al 4 de Agosto				7 al 11 de Agosto			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Financiero	12	47	652	679	3	31	379	372	4	38	366	348
Real	47	12	457	429	31	3	230	236	38	4	233	251
Total	60	60	1108	1108	34	34	608	608	43	43	599	599

* 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 25 de julio se presenta la proyección de vencimientos.