

Fecha de Publicación: 27 de Julio de 2006
Fecha de Información: 25 de Julio de 2006¹

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Según el reporte de los Intermediarios del Mercado Cambiario durante el día se pactó un total de US\$314,2 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de 0,9%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero		Sector Real		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	21,8	33,0	33,0	21,8	54,7
15-35	80,5	132,7	123,7	71,5	204,2
36-60	0,1	4,9	4,9	0,1	5,0
61-90	11,1	20,9	11,2	1,4	22,3
91-180	20,9	14,5	4,8	11,2	25,8
>180	0,0	2,2	2,2	0,0	2,2
Total	134,4	208,2	179,8	106,0	314,2

* Cifras en millones de dólares

Cuadro No. 2
Devaluación Implícita Anualizada

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

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	13	47	667	686	3	31	383	396	4	39	375	353
Real	47	13	464	445	31	3	253	240	39	4	238	260
Total	60	60	1130	1130	34	34	636	636	43	43	614	614

* Cifras en millones de dólares

¹ Datos provisionales.

² La fórmula para la devaluación implícita es: ((Tasa Pactada/Promedio SET FX) ^ (365/Plazo)) - 1

³ A partir del 26 de julio se presenta la proyección de vencimientos.