

Fecha de Publicación: 14 de Julio de 2006
Fecha de Información: 12 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\$138,5 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de 2,6%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero		Sector Real		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	16,2	18,3	6,3	4,2	22,5
15-35	25,3	61,9	45,6	9,0	70,9
36-60	0,5	0,3	0,3	0,5	0,8
61-90	0,1	28,1	28,1	0,1	28,1
91-180	6,0	5,2	0,2	1,0	6,1
>180	5,0	5,0	5,0	5,0	10,0
Total	53,0	118,8	85,5	19,7	138,5

* Cifras en millones de dólares

Cuadro No. 2
Devaluación Implícita Anualizada

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

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	7	20	270	485	10	59	567	580
Real	44	19	408	359	20	7	395	181	59	10	372	360
Total	63	63	1088	1088	27	27	666	666	69	69	940	940

* 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 13 de julio se presenta la proyección de vencimientos.