

Fecha de Publicación: 19 de Julio de 2006
Fecha de Información: 17 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\$127,4 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	17,8	42,0	27,0	2,8	44,8
15-35	38,5	39,1	32,1	31,5	70,6
36-60	2,0	4,2	2,2	0,0	4,2
61-90	1,4	0,2	0,2	1,4	1,6
91-180	0,0	2,2	2,2	0,0	2,2
>180	3,0	0,9	0,9	3,0	3,9
Total	62,8	88,6	64,6	38,8	127,4

* Cifras en millones de dólares

Cuadro No. 2
Devaluación Implícita Anualizada

Rango	Promedio Simple	Promedio Ponderado por Monto
3-14	-0,3 %	3,4 %
15-35	2,1 %	2,4 %
36-60	2,1 %	2,5 %
61-90	2,4 %	2,1 %
91-180	2,7 %	2,5 %
>180	2,6 %	2,4 %
Total	1,5 %	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	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	11	20	331	494	11	59	624	634	3	29	340	308
Real	20	11	400	237	59	11	417	407	29	3	184	216
Total	31	31	731	731	70	70	1041	1041	32	32	524	524

* 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 18 de julio se presenta la proyección de vencimientos.