

Fecha de Publicación: 24 de Julio de 2006
Fecha de Información: 19 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\$270,4 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de 3,6%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero		Sector Real		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	8,4	23,8	23,8	8,4	32,2
15-35	89,0	86,4	56,4	59,0	145,5
36-60	21,2	4,9	2,8	19,1	23,9
61-90	46,3	18,3	18,3	46,3	64,6
91-180	0,4	2,1	2,1	0,4	2,5
>180	0,6	1,2	1,2	0,6	1,7
Total	165,8	136,7	104,6	133,7	270,4

* Cifras en millones de dólares

Cuadro No. 2
Devaluación Implícita Anualizada

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

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	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	495	11	41	632	666	3	29	370	360
Real	20	10	401	238	41	11	449	415	29	3	217	227
Total	30	30	733	733	52	52	1081	1081	32	32	587	587

* 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 20 de julio se presenta la proyección de vencimientos.