

Fecha de Publicación: 30 de Junio de 2006
Fecha de Información: 28 de Junio 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\$245,0 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de 1,7%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero		Sector Real		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	21,4	10,7	10,7	21,4	32,1
15-35	102,2	49,9	23,3	75,6	125,4
36-60	13,4	11,1	0,5	2,8	13,9
61-90	0,3	36,0	36,0	0,3	36,3
91-180	2,2	28,9	28,9	2,2	31,0
>180	5,8	1,1	0,5	5,1	6,2
Total	145,2	137,7	99,8	107,4	245,0

* Cifras en millones de dólares

Cuadro No. 2
Devaluación Implícita Anualizada

Rango	Promedio Simple	Promedio Ponderado por Monto
3-14	1,9 %	-2,3 %
15-35	2,5 %	2,2 %
36-60	2,0 %	3,9 %
61-90	3,2 %	1,2 %
91-180	2,8 %	3,5 %
>180	1,5 %	1,2 %
Total	2,4 %	1,7 %

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	10 al 14 de Julio				26 al 30 de Junio				3 al 7 de Julio			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Financiero	13	42	617	588	17	50	778	654	8	23	449	477
Real	42	13	287	316	50	17	418	542	23	8	321	293
Total	55	55	905	905	67	67	1196	1196	30	30	770	770

* 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 29 de junio se presenta la proyección de vencimientos.