

Fecha de Publicación: 4 de Julio de 2006
Fecha de Información: 29 de Junio 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\$266,0 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de 1,6%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero		Sector Real		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	11,0	36,8	36,8	11,0	47,8
15-35	130,1	72,5	56,3	113,9	186,4
36-60	12,8	10,6	0,4	2,6	13,2
61-90	0,0	11,5	11,5	0,0	11,5
91-180	0,0	5,9	5,9	0,0	5,9
>180	1,3	0,1	0,1	1,3	1,3
Total	155,2	137,2	110,8	128,8	266,0

* Cifras en millones de dólares

Cuadro No. 2
Devaluación Implícita Anualizada

Rango	Promedio Simple	Promedio Ponderado por Monto
3-14	-0,8 %	-4,1 %
15-35	1,7 %	2,6 %
36-60	2,9 %	5,0 %
61-90	3,4 %	4,7 %
91-180	3,1 %	3,2 %
>180	2,7 %	2,7 %
Total	1,6 %	1,6 %

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

Sector	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	620	602	18	50	778	654	9	23	455	502
Real	42	13	301	319	50	18	418	542	23	9	346	299
Total	55	55	921	921	68	68	1196	1196	31	31	801	801

* 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 30 de junio se presenta la proyección de vencimientos.