

Fecha de Publicación: 5 de Julio de 2006
Fecha de Información: 30 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\$345,8 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	10,0	28,4	28,4	10,0	38,5
15-35	97,7	135,4	97,1	59,3	194,8
36-60	56,5	6,4	6,4	56,5	62,9
61-90	22,4	9,5	9,5	22,4	31,9
91-180	9,2	9,4	3,1	2,9	12,3
>180	1,7	3,9	3,9	1,7	5,5
Total	197,5	193,0	148,4	152,8	345,8

* Cifras en millones de dólares

Cuadro No. 2
Devaluación Implícita Anualizada

Rango	Promedio Simple	Promedio Ponderado por Monto
3-14	5,8 %	5,9 %
15-35	2,2 %	2,2 %
36-60	1,0 %	2,0 %
61-90	3,2 %	2,4 %
91-180	3,2 %	2,7 %
>180	3,4 %	3,5 %
Total	2,8 %	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				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	15	42	625	619	18	50	778	654	10	24	457	513
Real	42	15	318	324	50	18	418	542	24	10	357	301
Total	57	57	943	943	68	68	1196	1196	34	34	814	814

* 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 3 de julio se presenta la proyección de vencimientos.