

Fecha de Publicación: 6 de Julio de 2006
Fecha de Información: 4 de Julio 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\$93,2 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de 2,2%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero		Sector Real		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	0,5	12,3	12,3	0,5	12,9
15-35	16,0	29,7	29,7	16,0	45,7
36-60	24,2	1,5	1,5	24,2	25,7
61-90	1,6	4,6	4,6	1,6	6,1
91-180	0,6	1,7	1,7	0,6	2,3
>180	0,1	0,5	0,5	0,1	0,5
Total	42,9	50,2	50,2	42,9	93,2

* Cifras en millones de dólares

Cuadro No. 2
Devaluación Implícita Anualizada

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

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	3 al 7 de Julio				10 al 14 de Julio				17 al 21 de Julio			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Financiero	11	24	458	513	13	44	626	630	5	18	185	417
Real	24	11	357	301	44	13	329	325	18	5	343	111
Total	35	35	814	814	57	57	955	955	23	23	527	527

* 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 5 de julio se presenta la proyección de vencimientos.