

Fecha de Publicación: 7 de Julio de 2006
Fecha de Información: 05 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\$271,4 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	27,0	34,1	19,1	12,0	46,1
15-35	101,6	104,8	40,8	37,6	142,4
36-60	47,0	35,5	3,5	15,0	50,5
61-90	15,9	8,8	8,8	15,9	24,7
91-180	6,8	0,2	0,2	6,8	7,0
>180	0,7	0,0	0,0	0,7	0,7
Total	199,0	183,5	72,4	87,9	271,4

* Cifras en millones de dólares

Cuadro No. 2
Devaluación Implícita Anualizada

Rango	Promedio Simple	Promedio Ponderado por Monto
3-14	3,9 %	-0,5 %
15-35	3,0 %	3,2 %
36-60	2,8 %	3,8 %
61-90	2,9 %	2,6 %
91-180	2,7 %	2,8 %
>180	1,9 %	2,2 %
Total	3,0 %	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	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	14	44	646	657	6	18	190	424
Real	24	11	357	301	44	14	346	335	18	6	345	111
Total	35	35	815	815	57	57	992	992	24	24	535	535

* 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 6 de julio se presenta la proyección de vencimientos.