

Fecha de Publicación: 10 de Julio de 2006
Fecha de Información: 6 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\$212,4 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de 3,5%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero		Sector Real		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	12,0	29,5	29,5	12,0	41,6
15-35	45,2	79,5	69,5	35,2	114,6
36-60	16,1	11,7	11,7	16,1	27,8
61-90	5,6	10,8	9,8	4,6	15,5
91-180	2,7	9,9	9,9	2,7	12,6
>180	0,3	0,1	0,1	0,3	0,4
Total	81,9	141,5	130,5	70,9	212,4

* Cifras en millones de dólares

Cuadro No. 2
Devaluación Implícita Anualizada

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

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	13	24	458	513	13	44	657	686	6	19	190	428
Real	24	13	357	301	44	13	375	346	19	6	349	111
Total	36	36	815	815	57	57	1032	1032	24	24	539	539

* 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 7 de julio se presenta la proyección de vencimientos.