

Fecha de Publicación: 12 de Julio de 2006
Fecha de Información: 10 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\$222,4 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de 4,2%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero		Sector Real		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	18,0	29,5	19,5	8,0	37,5
15-35	69,6	48,6	27,6	48,6	97,2
36-60	10,8	2,0	1,9	10,8	12,7
61-90	31,8	53,5	23,5	1,8	55,3
91-180	14,6	13,0	3,0	4,6	17,7
>180	0,0	2,0	2,0	0,0	2,0
Total	144,8	148,6	77,6	73,8	222,4

* Cifras en millones de dólares

Cuadro No. 2
Devaluación Implícita Anualizada

Rango	Promedio Simple	Promedio Ponderado por Monto
3-14	1,7 %	12,1 %
15-35	1,9 %	1,3 %
36-60	1,2 %	-0,6 %
61-90	2,7 %	5,4 %
91-180	2,5 %	3,7 %
>180	3,0 %	3,1 %
Total	2,0 %	4,2 %

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	10 al 14 de Julio				17 al 21 de Julio				24 al 28 de Julio			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Financiero	16	43	683	729	6	19	221	456	12	59	514	533
Real	43	16	408	362	19	6	377	142	59	12	348	329
Total	59	59	1090	1090	25	25	598	598	70	70	862	862

* 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 11 de julio se presenta la proyección de vencimientos.