

Fecha de Publicación: 14 de Junio de 2006
Fecha de Información: 12 de Junio 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\$158,2 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de 5,6%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero		Sector Real		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	29,7	15,8	5,8	19,7	35,5
15-35	41,5	60,5	41,2	22,2	82,7
36-60	2,2	20,8	20,8	2,2	23,0
61-90	3,0	3,2	0,2	0,0	3,2
91-180	11,5	0,8	0,8	11,5	12,3
>180	0,5	1,1	1,1	0,5	1,5
Total	88,3	102,2	69,9	56,0	158,2

* Cifras en millones de dólares

Cuadro No. 2
Devaluación Implícita Anualizada

Rango	Promedio Simple	Promedio Ponderado por Monto
3-14	7,8 %	13,9 %
15-35	1,7 %	3,2 %
36-60	1,6 %	4,4 %
61-90	1,9 %	1,8 %
91-180	1,8 %	1,9 %
>180	2,3 %	2,2 %
Total	3,0 %	5,6 %

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	12 al 16 de Junio				19 al 23 de Junio				26 al 30 de Junio			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Financiero	55	44	876	1056	13	21	581	731	13	22	579	567
Real	44	55	603	423	21	13	518	368	22	13	378	390
Total	99	99	1479	1479	34	34	1099	1099	34	34	957	957

* 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 13 de junio se presenta la proyección de vencimientos.