

Fecha de Publicación: 15 de Junio de 2006
Fecha de Información: 13 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\$317,7 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de 2,8%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero		Sector Real		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	33,1	31,2	25,2	27,1	58,3
15-35	118,2	62,0	44,0	100,2	162,2
36-60	0,9	0,9	0,9	0,9	1,8
61-90	4,7	36,9	36,9	4,7	41,6
91-180	1,4	10,5	10,5	1,4	11,9
>180	31,9	10,0	10,0	31,9	41,9
Total	190,1	151,5	127,5	166,1	317,7

* Cifras en millones de dólares

Cuadro No. 2
Devaluación Implícita Anualizada

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

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	57	55	881	1049	13	29	606	746	13	22	623	581
Real	55	57	593	425	29	13	533	393	22	13	389	431
Total	112	112	1474	1474	41	41	1139	1139	35	35	1012	1012

* 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 14 de junio se presenta la proyección de vencimientos.