

Fecha de Publicación: 16 de Junio de 2006
Fecha de Información: 14 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\$180,4 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de 3,3%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero		Sector Real		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	22,1	17,1	15,3	20,3	37,4
15-35	32,5	67,8	50,8	15,5	83,3
36-60	16,4	13,9	0,9	3,4	17,3
61-90	1,2	33,6	32,6	0,2	33,7
91-180	0,8	7,8	7,8	0,8	8,5
>180	0,2	0,1	0,1	0,2	0,3
Total	73,1	140,1	107,4	40,3	180,4

* Cifras en millones de dólares

Cuadro No. 2
Devaluación Implícita Anualizada

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

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

Sector	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	52	55	886	1049	13	36	617	754	13	22	638	588
Real	55	52	593	430	36	13	540	403	22	13	396	445
Total	107	107	1479	1479	49	49	1157	1157	35	35	1033	1033

* 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 15 de junio se presenta la proyección de vencimientos.