

Fecha de Publicación: 20 de Junio de 2006
Fecha de Información: 15 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\$221,1 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de 1,0%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero		Sector Real		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	25,5	28,0	24,0	21,5	49,5
15-35	29,4	100,6	90,6	19,4	120,0
36-60	5,7	7,0	2,0	0,7	7,7
61-90	1,9	8,4	8,4	1,9	10,3
91-180	13,9	20,8	15,8	8,9	29,7
>180	3,8	0,1	0,1	3,8	3,9
Total	80,2	164,9	140,9	56,2	221,1

* Cifras en millones de dólares

Cuadro No. 2
Devaluación Implícita Anualizada

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

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	53	55	885	1050	14	42	628	762	13	22	660	603
Real	55	53	594	429	42	14	548	414	22	13	406	463
Total	108	108	1479	1479	56	56	1176	1176	36	36	1066	1066

* 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 16 de junio se presenta la proyección de vencimientos.