

Fecha de Publicación: 21 de Junio de 2006
Fecha de Información: 16 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\$94,5 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de -1,9%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

| Rango | Sector Financiero | | Sector Real | | Total |
|--------------|-------------------|-------------|-------------|-------------|-------------|
| | Compras | Ventas | Compras | Ventas | |
| 3-14 | 32,4 | 6,1 | 6,1 | 32,4 | 38,5 |
| 15-35 | 13,9 | 24,0 | 21,9 | 11,9 | 35,9 |
| 36-60 | 2,3 | 2,6 | 0,5 | 0,3 | 2,8 |
| 61-90 | 1,9 | 1,0 | 1,0 | 1,9 | 3,0 |
| 91-180 | 10,1 | 14,2 | 4,2 | 0,1 | 14,3 |
| >180 | 0,0 | 0,0 | 0,0 | 0,0 | 0,0 |
| Total | 60,7 | 47,9 | 33,8 | 46,6 | 94,5 |

* Cifras en millones de dólares

Cuadro No. 2
Devaluación Implícita Anualizada

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

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 | 54 | 886 | 1051 | 14 | 42 | 625 | 764 | 14 | 22 | 690 | 607 |
| Real | 54 | 53 | 595 | 430 | 42 | 14 | 550 | 411 | 22 | 14 | 410 | 493 |
| Total | 107 | 107 | 1480 | 1480 | 56 | 56 | 1174 | 1174 | 37 | 37 | 1100 | 1100 |

* 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 19 de junio se presenta la proyección de vencimientos.