

Fecha de Publicación: 22 de Junio de 2006
Fecha de Información: 20 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\$179,3 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de 1,8%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero		Sector Real		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	10,9	12,2	6,2	4,9	17,1
15-35	43,1	127,2	95,3	11,2	138,4
36-60	8,2	5,5	0,0	2,7	8,3
61-90	0,5	4,5	4,5	0,5	5,1
91-180	0,6	0,1	0,1	0,6	0,7
>180	0,1	9,6	9,6	0,1	9,7
Total	63,5	159,2	115,8	20,1	179,3

* Cifras en millones de dólares

Cuadro No. 2
Devaluación Implícita Anualizada

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

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	26 al 30 de Junio				3 al 7 de Julio				19 al 23 de Junio			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Financiero	16	25	698	616	7	20	424	450	14	42	625	764
Real	25	16	414	495	20	7	299	272	42	14	550	411
Total	42	42	1112	1112	27	27	722	722	56	56	1175	1175

* 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 21 de junio se presenta la proyección de vencimientos.