

Fecha de Publicación: 28 de Junio de 2006
Fecha de Información: 23 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\$201,8 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de 1,4%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero		Sector Real		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	15,9	17,1	17,1	15,9	32,9
15-35	66,0	70,6	56,6	52,0	122,6
36-60	7,9	24,3	24,3	7,9	32,2
61-90	2,2	9,1	9,1	2,2	11,2
91-180	0,6	1,8	1,8	0,6	2,3
>180	0,3	0,2	0,2	0,3	0,5
Total	92,8	123,0	108,9	78,8	201,8

* Cifras en millones de dólares

Cuadro No. 2
Devaluación Implícita Anualizada

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

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	19 al 23 de Junio				26 al 30 de Junio				3 al 7 de Julio			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Financiero	15	42	625	764	17	25	766	675	7	20	435	459
Real	42	15	550	411	25	17	443	534	20	7	303	279
Total	58	58	1174	1174	42	42	1209	1209	28	28	738	738

* 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 26 de junio se presenta la proyección de vencimientos.