

Fecha de Publicación: 31 de Mayo de 2006
Fecha de Información: 26 de Mayo de 2006 ¹

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Según el reporte de los Intermediarios del Mercado Cambiario durante el día se pactó un total de US\$223,3 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de 0,9%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero		Sector Real		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	14,5	27,9	27,9	14,5	42,4
15-35	74,0	85,2	64,2	53,0	138,2
36-60	2,6	28,2	28,2	2,6	30,8
61-90	3,0	1,3	1,3	3,0	4,3
91-180	2,6	4,6	4,6	2,6	7,2
>180	0,3	0,2	0,2	0,3	0,4
Total	97,0	147,3	126,3	76,0	223,3

* Cifras en millones de dólares

Cuadro No. 2
Devaluación Implícita Anualizada

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

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	22 al 26 de Mayo				29 de May. al 2 de Junio				5 al 9 de Junio			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Financiero	18	126	719	672	10	71	686	608	7	95	710	624
Real	126	18	382	430	71	10	410	488	95	7	295	381
Total	144	144	1101	1101	81	81	1096	1096	102	102	1005	1005

* 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 29 de mayo se presenta la proyección de vencimientos.