

Fecha de Publicación: 09 de Junio de 2006
Fecha de Información: 07 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\$213,8 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de 3,4%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero		Sector Real		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	54,6	56,8	6,8	4,6	61,4
15-35	99,7	76,0	47,0	70,7	146,6
36-60	0,3	0,2	0,2	0,3	0,5
61-90	0,3	4,1	4,1	0,3	4,4
91-180	0,2	0,2	0,2	0,2	0,4
>180	0,1	0,4	0,4	0,1	0,5
Total	155,1	137,7	58,7	76,1	213,8

* Cifras en millones de dólares

Cuadro No. 2
Devaluación Implícita Anualizada

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

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	5 al 9 de Junio				12 al 16 de Junio				19 al 23 de Junio			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Financiero	19	93	770	683	21	43	804	979	5	19	527	686
Real	93	19	336	423	43	21	578	402	19	5	488	329
Total	112	112	1106	1106	64	64	1382	1382	24	24	1015	1015

* 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 8 de junio se presenta la proyección de vencimientos.