

Fecha de Publicación: 13 de Junio de 2006
Fecha de Información: 09 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\$177,3 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de -3,6%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero		Sector Real		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	81,1	72,0	29,0	38,1	110,0
15-35	36,7	35,4	19,3	20,6	56,0
36-60	1,5	0,9	0,9	1,5	2,4
61-90	0,0	3,6	3,6	0,0	3,6
91-180	0,0	5,1	5,1	0,0	5,1
>180	0,1	0,1	0,1	0,1	0,2
Total	119,4	117,0	58,0	60,3	177,3

* Cifras en millones de dólares

Cuadro No. 2
Devaluación Implícita Anualizada

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

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

Sector	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	22	93	770	683	54	44	864	1046	12	20	566	726
Real	93	22	336	423	44	54	603	421	20	12	512	353
Total	115	115	1106	1106	97	97	1467	1467	32	32	1078	1078

* 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 12 de junio se presenta la proyección de vencimientos.