

Fecha de Publicación: 01 de Junio de 2006
Fecha de Información: 30 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\$351,5 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de 4,7%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero		Sector Real		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	41,1	40,2	15,2	16,1	56,2
15-35	89,6	155,9	118,9	52,6	208,5
36-60	33,7	61,6	30,6	2,7	64,3
61-90	1,7	0,1	0,1	1,7	1,8
91-180	7,8	12,2	12,2	7,8	19,9
>180	0,5	0,2	0,2	0,5	0,7
Total	174,4	270,1	177,1	81,4	351,5

* Cifras en millones de dólares

Cuadro No. 2
Devaluación Implícita Anualizada

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

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				29 de May. al 2 de Junio			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Financiero	8	95	724	638	17	43	674	841	9	75	690	608
Real	94	8	309	395	43	17	542	375	75	9	410	492
Total	102	102	1033	1033	60	60	1216	1216	85	85	1100	1100

* 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 31 de mayo se presenta la proyección de vencimientos.