

Fecha de Publicación: 06 de Junio de 2006
Fecha de Información: 02 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\$304,2 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de 2,8%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero		Sector Real		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	45,1	38,4	18,4	25,1	63,5
15-35	72,7	136,4	93,9	30,2	166,6
36-60	0,5	65,5	65,4	0,4	66,0
61-90	0,2	3,3	3,3	0,2	3,6
91-180	0,4	3,0	3,0	0,4	3,4
>180	0,0	1,2	1,2	0,0	1,2
Total	119,0	247,8	185,3	56,4	304,2

* Cifras en millones de dólares

Cuadro No. 2
Devaluación Implícita Anualizada

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

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	29 de May. al 2 de Junio				5 al 9 de Junio				12 al 16 de Junio			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Financiero	10	75	690	608	10	93	765	674	24	42	706	891
Real	75	10	410	492	93	10	327	418	42	24	576	391
Total	86	86	1100	1100	103	103	1093	1093	66	66	1281	1281

* 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 5 de junio se presenta la proyección de vencimientos.