

Fecha de Publicación: 07 de Junio de 2006
Fecha de Información: 05 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\$126,8 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de 2,6%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero		Sector Real		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	14,6	17,5	10,0	7,1	24,6
15-35	41,1	60,7	37,2	17,6	78,2
36-60	0,0	1,6	1,6	0,0	1,6
61-90	0,0	4,8	4,8	0,0	4,8
91-180	0,1	16,4	16,4	0,1	16,5
>180	0,0	1,0	1,0	0,0	1,0
Total	55,8	102,0	71,0	24,8	126,8

* Cifras en millones de dólares

Cuadro No. 2
Devaluación Implícita Anualizada

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

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

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	94	770	682	19	42	715	899	5	19	479	650
Real	94	19	335	423	42	19	577	392	19	5	476	306
Total	113	113	1105	1105	61	61	1291	1291	24	24	955	955

* Cifras en millones de dólares

¹ Datos provisionales.

² La fórmula para la devaluación implícita es: ((Tasa Pactada/Promedio SET FX) ^ (365/Plazo)) - 1

³ A partir del 6 de junio se presenta la proyección de vencimientos.