

Fecha de Publicación: 15 de Mayo de 2006
Fecha de Información: 11 de Mayo 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\$342,1 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	18,8	54,4	52,4	16,8	71,1
15-35	194,6	97,2	33,2	130,6	227,8
36-60	4,4	10,6	7,6	1,4	12,0
61-90	7,1	9,6	9,6	7,1	16,7
91-180	2,6	0,8	0,8	2,6	3,4
>180	5,2	5,9	5,9	5,2	11,1
Total	232,6	178,5	109,5	163,6	342,1

* Cifras en millones de dólares

Cuadro No. 2
Devaluación Implícita Anualizada

Rango	Promedio Simple	Promedio Ponderado por Monto
3-14	2,2 %	11,2 %
15-35	0,6 %	0,3 %
36-60	0,4 %	0,9 %
61-90	0,1 %	0,1 %
91-180	0,0 %	-0,8 %
>180	1,1 %	1,1 %
Total	0,8 %	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

Sector	8 al 12 de Mayo				15 al 19 de Mayo				22 al 26 de Mayo			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Financiero	12	39	494	529	14	59	477	499	8	126	489	438
Real	39	12	302	266	59	14	368	347	126	8	288	339
Total	51	51	796	796	74	74	846	846	134	134	777	777

* 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 12 de mayo se presenta la proyección de vencimientos.