

Fecha de Publicación: 05 de Mayo de 2006
 Fecha de Información: 03 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\$301,1 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de 0,1%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero		Sector Real		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	44,4	27,0	6,0	23,4	50,4
15-35	143,6	78,4	66,4	131,6	210,0
36-60	2,4	12,3	12,3	2,4	14,7
61-90	0,2	5,0	5,0	0,2	5,2
91-180	5,0	5,0	0,8	0,8	5,9
>180	15,0	0,0	0,0	15,0	15,0
Total	210,5	127,8	90,6	173,4	301,1

* Cifras en millones de dólares

Cuadro No. 2
Devaluación Implícita Anualizada

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

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	1 al 5 de Mayo				8 al 12 de Mayo				15 al 19 de Mayo			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Financiero	10	65	842	472	10	38	462	448	10	51	420	354
Real	65	10	201	570	38	10	242	256	51	10	257	322
Total	75	75	1043	1043	48	48	704	704	61	61	676	676

* 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 4 de mayo se presenta la proyección de vencimientos.