

Fecha de Publicación: 08 de Mayo de 2006
Fecha de Información: 04 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\$214,4 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	0,2	2,4	2,4	0,2	2,6
15-35	128,1	106,1	58,1	80,1	186,2
36-60	1,4	7,5	6,5	0,4	7,9
61-90	6,2	12,5	7,5	1,2	13,7
91-180	3,0	0,9	0,9	3,0	3,9
>180	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
Total	138,9	129,5	75,5	84,9	214,4

* Cifras en millones de dólares

Cuadro No. 2
Devaluación Implícita Anualizada

Rango	Promedio Simple	Promedio Ponderado por Monto
3-14	-2,7 %	-2,6 %
15-35	-0,3 %	-0,1 %
36-60	0,4 %	0,2 %
61-90	0,6 %	0,3 %
91-180	1,2 %	0,6 %
>180	1,4 %	1,4 %
Total	0,1 %	-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	64	842	473	11	38	462	450	10	51	425	358
Real	64	10	202	570	38	11	244	256	51	10	260	328
Total	74	74	1044	1044	48	48	706	706	61	61	686	686

* 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 mayo se presenta la proyección de vencimientos.