

Fecha de Publicación: 09 de Mayo de 2006
 Fecha de Información: 05 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\$394,3 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de 0,0%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero		Sector Real		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	38,1	65,5	40,5	13,1	78,6
15-35	114,7	96,3	66,3	84,7	181,0
36-60	2,3	26,5	26,5	2,3	28,7
61-90	1,6	12,1	12,1	1,6	13,7
91-180	65,8	15,6	15,6	65,8	81,3
>180	0,0	10,9	10,9	0,0	10,9
Total	222,4	227,0	172,0	167,4	394,3

* Cifras en millones de dólares

Cuadro No. 2
Devaluación Implícita Anualizada

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

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	11	64	841	473	11	48	479	463	13	53	444	398
Real	64	11	202	570	48	11	247	263	53	13	285	332
Total	75	75	1043	1043	59	59	726	726	66	66	730	730

* 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 8 de mayo se presenta la proyección de vencimientos.