

Fecha de Publicación: 11 de Mayo de 2006
Fecha de Información: 09 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\$264,7 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de -0,4%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero		Sector Real		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	15,1	15,4	4,4	4,1	19,5
15-35	111,9	168,5	87,5	30,9	199,4
36-60	7,9	7,5	6,5	6,9	14,4
61-90	14,0	4,8	4,8	14,0	18,8
91-180	0,0	5,9	5,9	0,0	6,0
>180	4,0	2,7	2,7	4,0	6,7
Total	153,0	204,7	111,7	60,0	264,7

* Cifras en millones de dólares

Cuadro No. 2
Devaluación Implícita Anualizada

Rango	Promedio Simple	Promedio Ponderado por Monto
3-14	-0,6 %	-2,7 %
15-35	-0,9 %	-0,3 %
36-60	-0,6 %	-0,3 %
61-90	0,1 %	0,3 %
91-180	0,9 %	0,2 %
>180	1,2 %	1,0 %
Total	-0,4 %	-0,4 %

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	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	49	490	519	14	56	457	438	7	126	462	415
Real	49	12	292	263	56	14	315	333	126	7	267	314
Total	61	61	782	782	70	70	771	771	133	133	729	729

* 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 10 de mayo se presenta la proyección de vencimientos.