

Fecha de Publicación: 12 de Mayo de 2006
Fecha de Información: 10 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\$385,6 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de 0,3%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero		Sector Real		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	21,8	22,5	15,5	14,8	37,3
15-35	69,7	138,4	98,4	29,7	168,1
36-60	36,4	20,8	20,8	36,4	57,2
61-90	59,0	2,2	2,2	59,0	61,2
91-180	18,1	8,4	8,4	18,1	26,5
>180	31,0	4,3	4,3	31,0	35,3
Total	236,0	196,7	149,7	189,0	385,6

* Cifras en millones de dólares

Cuadro No. 2
Devaluación Implícita Anualizada

Rango	Promedio Simple	Promedio Ponderado por Monto
3-14	-1,1 %	-2,8 %
15-35	0,5 %	1,3 %
36-60	0,1 %	-0,8 %
61-90	0,3 %	0,0 %
91-180	0,9 %	0,5 %
>180	1,0 %	0,6 %
Total	0,4 %	0,3 %

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	39	490	529	14	59	468	453	7	126	477	423
Real	39	12	302	263	59	14	322	338	126	7	275	329
Total	51	51	792	792	73	73	791	791	133	133	751	751

* 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 11 de mayo se presenta la proyección de vencimientos.