

Fecha de Publicación: 17 de Mayo de 2006
Fecha de Información: 15 de Mayo de 2006¹

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Según el reporte de los Intermediarios del Mercado Cambiario durante el día se pactó un total de US\$311,2 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de -1,8%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero		Sector Real		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	80,6	42,5	0,0	38,1	80,6
15-35	99,8	107,6	56,5	48,7	156,3
36-60	23,2	26,7	20,7	17,2	43,9
61-90	2,1	0,4	0,4	2,1	2,5
91-180	7,0	4,2	4,2	7,0	11,3
>180	13,4	5,1	3,1	11,4	16,5
Total	226,2	186,6	85,0	124,6	311,2

* Cifras en millones de dólares

Cuadro No. 2
Devaluación Implícita Anualizada

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

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	15 al 19 de Mayo				22 al 26 de Mayo				29 de May. al 2 de Junio			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Financiero	14	58	545	533	9	126	584	539	4	70	514	407
Real	58	14	396	408	126	9	323	368	70	4	279	385
Total	72	72	940	940	135	135	907	907	74	74	792	792

* 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 16 de mayo se presenta la proyección de vencimientos.