

Fecha de Publicación: 18 de Mayo de 2006
Fecha de Información: 16 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\$279,1 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 | 18,5 | 26,8 | 14,5 | 6,3 | 33,0 |
| 15-35 | 137,1 | 107,7 | 37,7 | 67,1 | 174,8 |
| 36-60 | 12,4 | 21,6 | 10,6 | 1,4 | 23,0 |
| 61-90 | 0,0 | 0,2 | 0,2 | 0,0 | 0,2 |
| 91-180 | 10,0 | 10,8 | 0,8 | 0,0 | 10,8 |
| >180 | 23,0 | 14,3 | 14,3 | 23,0 | 37,3 |
| Total | 200,9 | 181,4 | 78,2 | 97,7 | 279,1 |

* Cifras en millones de dólares

Cuadro No. 2
Devaluación Implícita Anualizada

| Rango | Promedio Simple | Promedio Ponderado por Monto |
|--------------|-----------------|------------------------------|
| 3-14 | 0,2 % | -1,0 % |
| 15-35 | -0,7 % | -0,2 % |
| 36-60 | 0,2 % | 0,8 % |
| 61-90 | 1,6 % | 1,2 % |
| 91-180 | 1,1 % | 0,8 % |
| >180 | 0,6 % | 0,6 % |
| Total | -0,1 % | 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 | 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 | 549 | 537 | 9 | 126 | 589 | 546 | 4 | 70 | 537 | 436 |
| Real | 58 | 14 | 396 | 408 | 126 | 9 | 327 | 370 | 70 | 4 | 294 | 395 |
| Total | 73 | 73 | 944 | 944 | 135 | 135 | 916 | 916 | 74 | 74 | 831 | 831 |

* 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 17 de mayo se presenta la proyección de vencimientos.