

Fecha de Publicación: 25 de Mayo de 2006
Fecha de Información: 23 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\$248,3 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de 1,6%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero		Sector Real		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	96,9	82,3	4,3	18,9	101,2
15-35	91,1	106,3	36,3	21,1	127,4
36-60	15,4	15,1	0,1	0,4	15,4
61-90	0,1	0,7	0,7	0,1	0,9
91-180	0,8	0,5	0,5	0,8	1,3
>180	2,0	0,1	0,1	2,0	2,1
Total	206,3	205,0	42,0	43,3	248,3

* Cifras en millones de dólares

Cuadro No. 2
Devaluación Implícita Anualizada

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

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	22 al 26 de Mayo				29 de May. al 2 de Junio				5 al 9 de Junio			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Financiero	16	127	719	670	9	71	645	541	5	95	678	578
Real	127	16	381	429	71	9	349	452	94	5	269	369
Total	144	144	1100	1100	80	80	994	994	99	99	947	947

* 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 24 de mayo se presenta la proyección de vencimientos.