

Fecha de Publicación: 24 de Marzo de 2006
Fecha de Información: 22 de Marzo 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\$297,3 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	30,2	41,0	16,0	5,2	46,2
15-35	141,7	106,7	61,7	96,7	203,4
36-60	29,7	5,6	0,6	24,7	30,3
61-90	5,8	7,0	7,0	5,8	12,8
91-180	2,2	0,0	0,0	2,2	2,2
>180	2,3	0,1	0,1	2,3	2,3
Total	211,9	160,4	85,4	136,9	297,3

* Cifras en millones de dólares

Cuadro No. 2
Devaluación Implícita Anualizada

Rango	Promedio Simple	Promedio Ponderado por Monto
3-14	-0,5 %	0,8 %
15-35	0,1 %	0,1 %
36-60	0,6 %	0,5 %
61-90	0,7 %	1,2 %
91-180	0,4 %	0,3 %
>180	0,7 %	0,6 %
Total	0,2 %	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	20 al 24 de Marzo				27 al 31 de Marzo				3 al 7 de Abril			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Financiero	4	72	432	319	5	162	611	436	4	207	444	284
Real	72	4	206	319	162	4	236	411	207	4	86	246
Total	76	76	638	638	167	167	847	847	211	211	530	530

* 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 23 de marzo se presenta la proyección de vencimientos.