

Fecha de Publicación: 10 de Abril de 2006
Fecha de Información: 06 de Abril 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\$363,2 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de 0,7%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

| Rango | Sector Financiero | | Sector Real | | Total |
|--------------|-------------------|--------------|--------------|--------------|--------------|
| | Compras | Ventas | Compras | Ventas | |
| 3-14 | 54,5 | 15,0 | 0,3 | 39,8 | 54,7 |
| 15-35 | 162,6 | 169,4 | 104,7 | 97,9 | 267,3 |
| 36-60 | 11,7 | 5,2 | 5,2 | 11,7 | 16,9 |
| 61-90 | 12,4 | 6,4 | 1,4 | 7,4 | 13,7 |
| 91-180 | 8,4 | 1,6 | 1,5 | 8,3 | 9,8 |
| >180 | 0,6 | 0,0 | 0,0 | 0,6 | 0,6 |
| Total | 250,1 | 197,5 | 113,1 | 165,7 | 363,2 |

* Cifras en millones de dólares

Cuadro No. 2
Devaluación Implícita Anualizada

| Rango | Promedio Simple | Promedio Ponderado por Monto |
|--------------|-----------------|------------------------------|
| 3-14 | 2,8 % | 4,9 % |
| 15-35 | 1,2 % | -0,3 % |
| 36-60 | 0,7 % | 2,0 % |
| 61-90 | 0,4 % | 1,2 % |
| 91-180 | 0,5 % | 0,7 % |
| >180 | 0,4 % | 0,2 % |
| Total | 1,0 % | 0,7 % |

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 | 3 al 7 de Abril | | | | 10 al 14 de Abril | | | | 17 al 21 de Abril | | | |
|-------------------|-----------------|-----|-----|-----|-------------------|----|-----|-----|-------------------|-----|-----|-----|
| | Delivery | | NDF | | Delivery | | NDF | | Delivery | | NDF | |
| | C | V | C | V | C | V | C | V | C | V | C | V |
| Financiero | 11 | 191 | 600 | 367 | 15 | 50 | 318 | 320 | 16 | 110 | 533 | 417 |
| Real | 191 | 11 | 98 | 330 | 50 | 15 | 224 | 222 | 110 | 16 | 204 | 320 |
| Total | 202 | 202 | 697 | 697 | 65 | 65 | 542 | 542 | 126 | 126 | 737 | 737 |

* Cifras en millones de dólares

¹ Datos provisionales.

² La fórmula para la devaluación implícita es: $((\text{Tasa Pactada}/\text{Promedio SET FX}) \wedge (365/\text{Plazo})) - 1$

³ A partir del 7 de abril se presenta la proyección de vencimientos.