

Fecha de Publicación: 12 de Abril de 2006
Fecha de Información: 10 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\$238,2 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	19,4	47,5	43,0	14,9	62,5
15-35	20,6	96,1	96,1	20,6	116,7
36-60	4,0	3,0	1,2	2,2	5,2
61-90	13,4	11,0	1,0	3,4	14,4
91-180	10,3	6,2	0,2	4,3	10,6
>180	27,3	7,5	1,5	21,3	28,8
Total	95,1	171,4	143,1	66,8	238,2

* Cifras en millones de dólares

Cuadro No. 2
Devaluación Implícita Anualizada

Rango	Promedio Simple	Promedio Ponderado por Monto
3-14	0,2 %	4,9 %
15-35	-2,0 %	-1,5 %
36-60	-0,4 %	-1,0 %
61-90	0,0 %	2,0 %
91-180	0,0 %	-0,2 %
>180	0,5 %	0,6 %
Total	-0,6 %	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	10 al 14 de Abril				17 al 21 de Abril				24 al 28 de Abril			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Financiero	16	50	322	325	23	122	607	488	12	91	754	611
Real	50	16	224	222	122	23	230	349	91	11	490	633
Total	67	67	546	546	145	145	837	837	103	103	1244	1244

* 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 11 de abril se presenta la proyección de vencimientos.