

Fecha de Publicación: 09 de Marzo de 2006
Fecha de Información: 07 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\$153,2 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de -1,1%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero		Sector Real		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	25,4	19,3	4,3	10,4	29,7
15-35	45,3	70,1	44,1	19,3	89,3
36-60	5,2	11,7	6,7	0,2	11,9
61-90	0,6	10,1	10,1	0,6	10,7
91-180	2,7	1,7	1,7	2,7	4,4
>180	7,1	0,0	0,0	7,1	7,1
Total	86,3	112,9	66,9	40,3	153,2

* Cifras en millones de dólares

Cuadro No. 2
Devaluación Implícita Anualizada

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

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

Sector	6 al 10 de Marzo				13 al 17 de Marzo				20 al 24 de Marzo			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Financiero	22	55	450	368	12	143	529	276	6	77	358	264
Real	55	22	187	269	143	12	117	371	76	6	193	288
Total	77	77	637	637	155	155	646	646	83	83	551	551

* 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 8 de marzo se presenta la proyección de vencimientos.