

Fecha de Publicación: 14 de Marzo de 2006
Fecha de Información: 10 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\$300,8 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de 2,1%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero		Sector Real		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	3,8	91,0	91,0	3,8	94,8
15-35	44,4	95,2	90,2	39,4	134,6
36-60	14,8	37,8	27,8	4,8	42,6
61-90	4,4	2,0	0,0	2,4	4,4
91-180	4,7	2,4	2,4	4,7	7,1
>180	15,2	2,0	2,0	15,2	17,2
Total	87,3	230,5	213,5	70,3	300,8

* Cifras en millones de dólares

Cuadro No. 2
Devaluación Implícita Anualizada

Rango	Promedio Simple	Promedio Ponderado por Monto
3-14	-3,8 %	9,6 %
15-35	-2,0 %	-1,9 %
36-60	-1,7 %	-0,8 %
61-90	-1,4 %	-0,7 %
91-180	-0,3 %	0,0 %
>180	0,3 %	0,5 %
Total	-1,6 %	2,1 %

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

Sectores	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	54	450	369	13	143	570	436	7	74	377	279
Real	54	22	188	269	143	13	238	373	74	7	198	297
Total	77	77	638	638	156	156	809	809	81	81	576	576

* 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 13 de marzo se presenta la proyección de vencimientos.