

Fecha de Publicación: 17 de Marzo de 2006
Fecha de Información: 15 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\$89,7 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	11,4	5,5	5,5	11,4	16,9
15-35	13,0	22,2	22,2	13,0	35,1
36-60	0,8	2,7	2,7	0,8	3,5
61-90	9,5	9,5	9,5	9,5	19,0
91-180	0,7	11,7	11,5	0,5	12,2
>180	1,0	2,0	2,0	1,0	3,0
Total	36,3	53,5	53,4	36,2	89,7

* Cifras en millones de dólares

Cuadro No. 2
Devaluación Implícita Anualizada

Rango	Promedio Simple	Promedio Ponderado por Monto
3-14	-0,8 %	-0,7 %
15-35	-0,5 %	-0,7 %
36-60	-0,7 %	-0,3 %
61-90	-0,1 %	-0,2 %
91-180	0,8 %	0,7 %
>180	0,9 %	0,8 %
Total	-0,3 %	-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	13 al 17 de Marzo				20 al 24 de Marzo				27 al 31 de Marzo			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Financiero	14	125	637	520	3	73	423	313	3	159	551	377
Real	125	14	282	398	73	3	207	318	159	3	226	400
Total	139	139	918	918	76	76	631	631	162	162	777	777

* 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 16 de marzo se presenta la proyección de vencimientos.