

Fecha de Publicación: 23 de Marzo de 2006
Fecha de Información: 21 de Marzo de 2006¹

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Según el reporte de los Intermediarios del Mercado Cambiario durante el día se pactó un total de US\$118,0 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de 0,1%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero		Sector Real		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	18,0	14,2	0,2	4,0	18,3
15-35	17,3	48,0	48,0	17,3	65,2
36-60	3,4	0,0	0,0	3,4	3,4
61-90	2,7	0,8	0,8	2,7	3,5
91-180	27,0	0,5	0,5	27,0	27,4
>180	0,0	0,2	0,2	0,0	0,2
Total	68,4	63,6	49,6	54,4	118,0

* Cifras en millones de dólares

Cuadro No. 2
Devaluación Implícita Anualizada

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

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	20 al 24 de Marzo				27 al 31 de Marzo				3 al 7 de Abril			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Financiero	4	73	432	320	3	161	584	401	3	200	438	284
Real	73	4	206	319	161	3	226	409	200	3	86	240
Total	77	77	639	639	164	164	810	810	204	204	524	524

* 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 22 de marzo se presenta la proyección de vencimientos.