

Fecha de Publicación: 29 de Marzo de 2006
Fecha de Información: 27 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\$260,8 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 | 70,1 | 56,0 | 0,0 | 14,1 | 70,1 |
| 15-35 | 76,9 | 89,3 | 60,3 | 47,9 | 137,2 |
| 36-60 | 16,5 | 15,0 | 15,0 | 16,5 | 31,5 |
| 61-90 | 1,3 | 1,1 | 1,1 | 1,3 | 2,4 |
| 91-180 | 7,7 | 6,7 | 1,7 | 2,7 | 9,4 |
| >180 | 3,4 | 6,8 | 6,8 | 3,4 | 10,2 |
| Total | 175,8 | 174,9 | 84,9 | 85,8 | 260,8 |

* Cifras en millones de dólares

Cuadro No. 2
Devaluación Implícita Anualizada

| Rango | Promedio Simple | Promedio Ponderado por Monto |
|--------------|-----------------|------------------------------|
| 3-14 | -0,5 % | -0,5 % |
| 15-35 | 0,4 % | 0,5 % |
| 36-60 | 0,4 % | 0,6 % |
| 61-90 | 0,8 % | 0,7 % |
| 91-180 | 0,5 % | 0,8 % |
| >180 | 0,8 % | 1,0 % |
| Total | 0,4 % | 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 | 27 al 31 de Marzo | | | | 3 al 7 de Abril | | | | 10 al 14 de Abril | | | |
|-------------------|-------------------|-----|-----|-----|-----------------|-----|-----|-----|-------------------|----|-----|-----|
| | Delivery | | NDF | | Delivery | | NDF | | Delivery | | NDF | |
| | C | V | C | V | C | V | C | V | C | V | C | V |
| Financiero | 9 | 185 | 632 | 464 | 5 | 188 | 529 | 346 | 2 | 53 | 281 | 225 |
| Real | 185 | 9 | 243 | 412 | 188 | 5 | 96 | 279 | 53 | 2 | 145 | 201 |
| Total | 194 | 194 | 875 | 875 | 193 | 193 | 625 | 625 | 54 | 54 | 426 | 426 |

* 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 28 de marzo se presenta la proyección de vencimientos.