

Fecha de Publicación: 30 de Marzo de 2006
Fecha de Información: 28 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\$305,6 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de 0,6%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero		Sector Real		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	31,9	19,1	8,1	20,9	40,0
15-35	80,9	114,1	114,1	80,9	195,1
36-60	38,0	7,4	7,4	38,0	45,4
61-90	3,7	0,7	0,7	3,7	4,5
91-180	10,0	0,8	0,8	10,0	10,7
>180	4,8	5,2	5,2	4,8	9,9
Total	169,3	147,3	136,3	158,3	305,6

* Cifras en millones de dólares

Cuadro No. 2
Devaluación Implícita Anualizada

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

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	649	464	6	188	542	359	3	53	283	272
Real	185	9	243	428	188	6	98	281	53	3	192	203
Total	194	194	892	892	194	194	640	640	56	56	475	475

* 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 29 de marzo se presenta la proyección de vencimientos.