

Fecha de Publicación: 31 de Marzo de 2006
Fecha de Información: 29 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\$223,1 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de -0,4%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero		Sector Real		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	68,0	1,1	0,1	67,0	68,1
15-35	71,5	61,2	48,2	58,5	119,7
36-60	10,6	0,6	0,6	10,6	11,2
61-90	13,9	0,4	0,4	13,9	14,3
91-180	6,0	1,7	1,5	5,8	7,4
>180	2,0	0,4	0,4	2,0	2,4
Total	172,0	65,3	51,1	157,8	223,1

* Cifras en millones de dólares

Cuadro No. 2
Devaluación Implícita Anualizada

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

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	10	185	649	464	6	188	588	360	4	52	303	272
Real	185	10	243	428	188	6	98	326	52	4	192	223
Total	195	195	892	892	194	194	686	686	56	56	495	495

* 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 30 de marzo se presenta la proyección de vencimientos.