

Fecha de Publicación: 3 de Abril de 2006
Fecha de Información: 30 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\$325,5 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de 0,0%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero		Sector Real		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	19,4	38,1	30,1	11,4	49,5
15-35	218,6	44,5	24,5	198,6	243,1
36-60	8,9	2,2	0,2	6,9	9,0
61-90	7,9	2,3	2,3	7,9	10,2
91-180	10,7	5,4	0,4	5,7	11,1
>180	2,3	0,2	0,2	2,3	2,5
Total	267,9	92,6	57,6	232,9	325,5

* Cifras en millones de dólares

Cuadro No. 2
Devaluación Implícita Anualizada

Rango	Promedio Simple	Promedio Ponderado por Monto
3-14	6,9 %	0,1 %
15-35	1,4 %	-0,1 %
36-60	1,8 %	1,0 %
61-90	1,2 %	0,7 %
91-180	0,9 %	0,8 %
>180	1,0 %	1,0 %
Total	1,6 %	0,0 %

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	184	649	465	8	188	593	363	4	52	316	307
Real	184	10	244	428	188	8	98	328	52	4	222	231
Total	194	194	893	893	195	195	692	692	56	56	538	538

* 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 31 de marzo se presenta la proyección de vencimientos.