

Fecha de Publicación: 04 de Abril de 2006
Fecha de Información: 31 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\$180,2 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	3,0	1,2	1,2	3,0	4,2
15-35	72,4	63,1	34,1	43,4	106,5
36-60	32,2	1,1	1,1	32,2	33,3
61-90	4,7	2,1	2,1	4,7	6,8
91-180	25,6	3,5	3,5	25,6	29,1
>180	0,3	0,0	0,0	0,3	0,3
Total	138,2	71,0	42,0	109,2	180,2

* Cifras en millones de dólares

Cuadro No. 2
Devaluación Implícita Anualizada

Rango	Promedio Simple	Promedio Ponderado por Monto
3-14	0,1 %	0,8 %
15-35	-0,2 %	0,2 %
36-60	0,2 %	0,3 %
61-90	0,3 %	0,5 %
91-180	0,7 %	0,8 %
>180	0,6 %	0,4 %
Total	0,1 %	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	10	184	649	465	10	188	593	364	4	52	316	307
Real	184	10	244	429	188	10	99	329	52	4	222	231
Total	194	194	894	894	198	198	693	693	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 3 de abril se presenta la proyección de vencimientos.