

Fecha de Publicación: 07 de Abril de 2006
Fecha de Información: 05 de Abril 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\$259,6 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de -0,9%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero		Sector Real		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	11,1	10,0	0,5	1,6	11,6
15-35	184,2	127,7	34,9	91,5	219,1
36-60	2,4	1,5	0,3	1,2	2,7
61-90	2,0	0,2	0,2	2,0	2,3
91-180	4,6	16,2	16,2	4,6	20,8
>180	1,9	1,2	1,2	1,9	3,0
Total	206,2	156,8	53,4	102,7	259,6

* Cifras en millones de dólares

Cuadro No. 2
Devaluación Implícita Anualizada

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

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	3 al 7 de Abril				10 al 14 de Abril				17 al 21 de Abril			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Financiero	11	191	600	367	4	52	327	318	15	109	462	394
Real	191	11	98	330	52	4	222	232	109	15	204	272
Total	202	202	697	697	56	56	549	549	124	124	666	666

* 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 6 de abril se presenta la proyección de vencimientos.