

Fecha de Publicación: 11 de Abril de 2006
Fecha de Información: 07 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\$249,5 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de -1,9%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero		Sector Real		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	65,3	66,2	20,2	19,3	85,5
15-35	50,5	40,2	40,2	50,5	90,7
36-60	36,2	0,7	0,7	36,2	36,9
61-90	17,8	0,0	0,0	17,8	17,8
91-180	12,0	0,3	0,3	12,0	12,3
>180	6,3	0,0	0,0	6,3	6,3
Total	188,1	107,4	61,4	142,0	249,5

* Cifras en millones de dólares

Cuadro No. 2
Devaluación Implícita Anualizada

Rango	Promedio Simple	Promedio Ponderado por Monto
3-14	6,0 %	-3,9 %
15-35	-0,3 %	-3,9 %
36-60	0,3 %	5,6 %
61-90	-0,2 %	-0,9 %
91-180	0,4 %	0,7 %
>180	1,2 %	1,3 %
Total	1,0 %	-1,9 %

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

Sector	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	16	50	322	324	21	120	589	468
Real	191	11	98	330	50	16	224	222	120	21	214	335
Total	202	202	697	697	67	67	546	546	141	141	803	803

* 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 10 de abril se presenta la proyección de vencimientos.