

Fecha de Publicación: 24 de Abril de 2006
Fecha de Información: 20 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\$222,1 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	40,9	27,6	0,6	13,9	41,6
15-35	85,1	100,5	70,5	55,1	155,6
36-60	2,6	0,5	0,5	2,6	3,2
61-90	14,2	2,7	2,7	14,2	17,0
91-180	2,1	1,6	1,6	2,1	3,8
>180	0,4	0,5	0,5	0,4	0,9
Total	145,5	133,5	76,5	88,5	222,1

* Cifras en millones de dólares

Cuadro No. 2
Devaluación Implícita Anualizada

Rango	Promedio Simple	Promedio Ponderado por Monto
3-14	-1,0 %	1,1 %
15-35	-0,1 %	-1,1 %
36-60	0,5 %	2,1 %
61-90	0,6 %	0,9 %
91-180	1,7 %	2,0 %
>180	1,4 %	1,8 %
Total	0,3 %	-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	17 al 21 de Abril				24 al 28 de Abril				1 al 5 de Mayo			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Financiero	35	122	626	531	14	94	976	851	6	65	715	353
Real	122	35	273	368	94	14	584	709	65	6	184	546
Total	157	157	899	899	108	108	1559	1559	71	71	899	899

* 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 21 de abril se presenta la proyección de vencimientos.