

Fecha de Publicación: 25 de Abril de 2006
Fecha de Información: 21 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\$207,1 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	49,1	43,0	2,0	8,1	51,1
15-35	37,8	50,3	46,3	33,8	84,1
36-60	10,6	46,2	46,2	10,6	56,8
61-90	0,1	2,1	2,1	0,1	2,2
91-180	0,4	11,9	11,9	0,4	12,4
>180	0,5	0,0	0,0	0,5	0,5
Total	98,5	153,6	108,6	53,5	207,1

* Cifras en millones de dólares

Cuadro No. 2
Devaluación Implícita Anualizada

Rango	Promedio Simple	Promedio Ponderado por Monto
3-14	-1,5 %	-1,5 %
15-35	-0,2 %	-0,5 %
36-60	0,1 %	0,3 %
61-90	0,5 %	0,9 %
91-180	1,8 %	0,9 %
>180	1,0 %	0,7 %
Total	-0,1 %	-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	123	627	530	15	94	992	862	6	65	747	385
Real	123	35	272	368	94	15	584	714	65	6	185	548
Total	158	158	899	899	109	109	1576	1576	71	71	933	933

* 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 24 de abril se presenta la proyección de vencimientos.