

Fecha de Publicación: 27 de Abril de 2006
Fecha de Información: 25 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\$309,2 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de -2,3%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero		Sector Real		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	80,7	56,5	2,0	26,2	82,7
15-35	102,1	166,5	99,5	35,1	201,7
36-60	11,3	7,5	7,5	11,3	18,8
61-90	4,1	0,7	0,7	4,1	4,8
91-180	0,2	0,7	0,7	0,2	0,9
>180	0,1	0,1	0,1	0,1	0,2
Total	198,6	232,1	110,6	77,1	309,2

* Cifras en millones de dólares

Cuadro No. 2
Devaluación Implícita Anualizada

Rango	Promedio Simple	Promedio Ponderado por Monto
3-14	-3,3 %	-10,0 %
15-35	-0,5 %	0,4 %
36-60	-0,6 %	0,8 %
61-90	-0,2 %	0,3 %
91-180	-0,3 %	1,2 %
>180	-0,7 %	0,3 %
Total	-1,0 %	-2,3 %

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

Sector	24 al 28 de Abril				1 al 5 de Mayo				8 al 12 de Mayo			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Financiero	15	95	1022	891	7	65	832	454	8	38	380	382
Real	95	15	587	718	65	7	189	568	38	8	213	212
Total	111	111	1608	1608	72	72	1022	1022	46	46	594	594

* Cifras en millones de dólares

¹ Datos provisionales.

² La fórmula para la devaluación implícita es: $((\text{Tasa Pactada}/\text{Promedio SET FX}) \wedge (365/\text{Plazo})) - 1$

³ A partir del 26 de abril se presenta la proyección de vencimientos.