

Fecha de Publicación: 28 de Abril de 2006
Fecha de Información: 26 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\$202,0 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de 0,3%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero		Sector Real		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	17,9	20,1	10,1	7,9	28,0
15-35	34,1	98,1	82,1	18,1	116,3
36-60	7,1	34,2	34,2	7,1	41,3
61-90	5,9	8,6	6,6	3,9	12,4
91-180	0,7	3,2	3,2	0,7	3,9
>180	0,0	0,2	0,2	0,0	0,2
Total	65,7	164,3	136,3	37,7	202,0

* Cifras en millones de dólares

Cuadro No. 2
Devaluación Implícita Anualizada

Rango	Promedio Simple	Promedio Ponderado por Monto
3-14	-2,3 %	-0,4 %
15-35	-0,9 %	-0,1 %
36-60	0,3 %	1,8 %
61-90	-0,1 %	0,1 %
91-180	0,8 %	1,1 %
>180	0,4 %	0,8 %
Total	-0,8 %	0,3 %

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

Sectores	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	17	94	1021	892	8	65	842	469	9	38	392	394
Real	94	17	588	717	65	8	199	572	38	9	220	218
Total	111	111	1609	1609	73	73	1041	1041	47	47	612	612

* 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 27 de abril se presenta la proyección de vencimientos.