

Fecha de Publicación: 03 de Mayo de 2006
Fecha de Información: 28 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\$228,1 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de -0,1%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero		Sector Real		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	9,3	5,0	3,0	7,3	12,4
15-35	107,4	45,3	45,3	107,4	152,8
36-60	20,1	29,9	21,9	12,1	41,9
61-90	3,3	7,7	7,7	3,3	11,0
91-180	1,1	6,7	6,7	1,1	7,7
>180	1,5	0,7	0,7	1,5	2,2
Total	142,8	95,3	85,3	132,8	228,1

* Cifras en millones de dólares

Cuadro No. 2
Devaluación Implícita Anualizada

Rango	Promedio Simple	Promedio Ponderado por Monto
3-14	3,1 %	2,9 %
15-35	-0,6 %	-0,8 %
36-60	0,6 %	0,8 %
61-90	0,5 %	0,2 %
91-180	0,6 %	1,3 %
>180	1,3 %	0,9 %
Total	0,4 %	-0,1 %

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	1028	893	9	65	852	472	9	38	417	419
Real	94	17	589	724	65	9	201	581	38	9	235	233
Total	111	111	1617	1617	74	74	1053	1053	47	47	652	652

* 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 1 de mayo se presenta la proyección de vencimientos.