

Fecha de Publicación: 18 de Abril de 2006
Fecha de Información: 12 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\$115,8 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	1,2	25,1	25,1	1,2	26,2
15-35	22,4	43,5	41,5	20,4	63,9
36-60	1,5	0,1	0,1	1,5	1,5
61-90	10,6	23,4	13,4	0,6	24,0
91-180	0,1	0,0	0,0	0,1	0,1
>180	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
Total	35,8	92,0	80,0	23,8	115,8

* Cifras en millones de dólares

Cuadro No. 2
Devaluación Implícita Anualizada

Rango	Promedio Simple	Promedio Ponderado por Monto
3-14	3,6 %	0,1 %
15-35	-2,9 %	1,1 %
36-60	-0,2 %	-0,5 %
61-90	-1,4 %	-0,8 %
91-180	-0,3 %	-0,3 %
>180	-0,6 %	-0,6 %
Total	-1,6 %	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	10 al 14 de Abril				17 al 21 de Abril				24 al 28 de Abril			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Financiero	18	50	322	320	31	122	617	521	12	93	757	648
Real	50	18	224	227	122	31	263	358	93	12	528	637
Total	68	68	546	546	153	153	880	880	105	105	1285	1285

* 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 13 de abril se presenta la proyección de vencimientos.