

Fecha de Publicación: 07 de Febrero de 2006
Fecha de Información: 03 de Febrero 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\$113,6 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	48,7	4,9	4,9	48,7	53,6
15-35	13,3	33,6	24,6	4,3	37,9
36-60	9,5	15,7	6,7	0,5	16,3
61-90	0,0	5,1	5,1	0,0	5,1
91-180	0,1	0,5	0,5	0,1	0,5
>180	0,1	0,0	0,0	0,1	0,2
Total	71,8	59,8	41,8	53,8	113,6

* Cifras en millones de dólares

Cuadro No. 2
Devaluación Implícita Anualizada

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

Sector	30 de Ene. al 3 de Febrero				6 al 10 de Febrero				13 al 17 de Febrero			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Financiero	26	98	497	347	7	94	501	429	14	123	485	402
Real	98	26	200	349	94	7	225	297	122	14	224	308
Total	123	123	697	697	101	101	726	726	136	136	710	710

* 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 6 de febrero se presenta la proyección de vencimientos.