

Fecha de Publicación: 08 de Febrero de 2006
Fecha de Información: 06 de Febrero de 2006¹

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Según el reporte de los Intermediarios del Mercado Cambiario durante el día se pactó un total de US\$189,3 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de ,0%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

| Rango | Sector Financiero | | Sector Real | | Total |
|--------------|-------------------|--------------|-------------|-------------|--------------|
| | Compras | Ventas | Compras | Ventas | |
| 3-14 | 54,4 | 10,2 | 0,2 | 44,4 | 54,6 |
| 15-35 | 35,2 | 54,4 | 29,4 | 10,2 | 64,5 |
| 36-60 | 16,0 | 15,7 | 15,7 | 16,0 | 31,6 |
| 61-90 | 0,0 | 31,8 | 31,8 | 0,0 | 31,8 |
| 91-180 | 1,0 | 5,6 | 5,6 | 1,0 | 6,6 |
| >180 | 0,0 | 0,1 | 0,1 | 0,0 | 0,1 |
| Total | 106,5 | 117,8 | 82,8 | 71,5 | 189,3 |

* Cifras en millones de dólares

Cuadro No. 2
Devaluación Implícita Anualizada

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

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 | 6 al 10 de Febrero | | | | 13 al 17 de Febrero | | | | 20 al 24 de Febrero | | | |
|-------------------|--------------------|-----|-----|-----|---------------------|-----|-----|-----|---------------------|----|-----|-----|
| | Delivery | | NDF | | Delivery | | NDF | | Delivery | | NDF | |
| | C | V | C | V | C | V | C | V | C | V | C | V |
| Financiero | 7 | 94 | 506 | 429 | 14 | 123 | 515 | 412 | 1 | 88 | 557 | 307 |
| Real | 94 | 7 | 225 | 302 | 122 | 14 | 225 | 328 | 88 | 1 | 191 | 441 |
| Total | 101 | 101 | 731 | 731 | 137 | 137 | 739 | 739 | 89 | 89 | 747 | 747 |

* 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 7 de febrero se presenta la proyección de vencimientos.