

Fecha de Publicación: 09 de Febrero de 2006
 Fecha de Información: 07 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\$159,0 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de ,8%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero		Sector Real		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	31,3	17,0	0,8	15,1	32,1
15-35	59,4	37,7	12,7	34,4	72,1
36-60	4,5	21,4	19,4	2,5	23,9
61-90	20,3	5,2	3,4	18,5	23,7
91-180	4,9	2,2	2,2	4,9	7,1
>180	0,0	0,2	0,2	0,0	0,2
Total	120,4	83,6	38,6	75,4	159,0

* Cifras en millones de dólares

Cuadro No. 2
Devaluación Implícita Anualizada

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

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	8	94	506	429	14	123	545	429	1	88	597	323
Real	94	8	225	302	122	14	225	342	88	1	191	465
Total	102	102	732	732	137	137	770	770	89	89	787	787

* 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 8 de febrero se presenta la proyección de vencimientos.