

Fecha de Publicación: 10 de Febrero de 2006
Fecha de Información: 08 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\$159,1 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	26,8	19,9	3,9	10,8	30,7
15-35	33,0	57,6	57,1	32,5	90,1
36-60	9,4	6,3	0,1	3,2	9,5
61-90	7,6	13,6	7,4	1,4	14,9
91-180	0,1	1,7	1,7	0,1	1,8
>180	0,0	12,0	12,0	0,0	12,0
Total	76,9	111,1	82,2	48,0	159,1

* Cifras en millones de dólares

Cuadro No. 2
Devaluación Implícita Anualizada

Rango	Promedio Simple	Promedio Ponderado por Monto
3-14	1,0 %	-0,3 %
15-35	-0,1 %	-0,1 %
36-60	0,2 %	0,3 %
61-90	0,0 %	0,2 %
91-180	0,9 %	0,8 %
>180	1,1 %	0,9 %
Total	0,4 %	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	8	94	506	429	16	126	567	445	1	90	612	335
Real	94	8	225	302	126	16	225	348	89	1	203	480
Total	102	102	732	732	142	142	792	792	90	90	815	815

* 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 9 de febrero se presenta la proyección de vencimientos.