

Fecha de Publicación: 13 de Febrero de 2006
Fecha de Información: 09 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\$96,9 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de ,2%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero		Sector Real		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	9,7	7,2	3,2	5,7	12,9
15-35	44,1	43,1	29,1	30,1	73,2
36-60	2,0	4,0	2,0	0,0	4,0
61-90	0,5	3,5	3,5	0,5	4,0
91-180	0,6	2,2	1,9	0,2	2,4
>180	0,0	0,4	0,4	0,0	0,4
Total	56,9	60,4	40,1	36,5	96,9

* Cifras en millones de dólares

Cuadro No. 2
Devaluación Implícita Anualizada

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

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	571	452	1	90	648	345
Real	94	8	225	302	126	16	228	348	89	1	203	506
Total	102	102	732	732	142	142	799	799	90	90	851	851

* 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 10 de febrero se presenta la proyección de vencimientos.