

Fecha de Publicación: 14 de Febrero de 2006
Fecha de Información: 10 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\$123,3 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de ,1%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero		Sector Real		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	5,4	1,1	1,1	5,4	6,5
15-35	36,2	24,8	24,8	36,2	61,0
36-60	13,6	4,3	4,3	13,6	17,9
61-90	20,0	5,1	5,1	20,0	25,1
91-180	4,2	5,6	5,6	4,2	9,8
>180	1,0	2,0	2,0	1,0	3,0
Total	80,4	42,9	42,9	80,4	123,3

* Cifras en millones de dólares

Cuadro No. 2
Devaluación Implícita Anualizada

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

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	430	15	126	572	452	1	94	653	341
Real	94	8	226	302	126	15	228	349	94	1	199	511
Total	102	102	733	733	142	142	800	800	95	95	853	853

* 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 13 de febrero se presenta la proyección de vencimientos.