

Fecha de Publicación: 16 de Febrero de 2006
Fecha de Información: 14 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\$220,5 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de ,9%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero		Sector Real		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	61,1	37,0	0,0	24,1	61,1
15-35	60,9	52,4	41,4	49,9	102,4
36-60	20,6	10,7	3,7	13,6	24,3
61-90	1,8	1,0	1,0	1,8	2,8
91-180	2,4	2,4	2,4	2,4	4,8
>180	25,2	0,0	0,0	25,2	25,2
Total	172,0	103,5	48,5	117,0	220,5

* Cifras en millones de dólares

Cuadro No. 2
Devaluación Implícita Anualizada

Rango	Promedio Simple	Promedio Ponderado por Monto
3-14	0,6 %	3,0 %
15-35	-0,2 %	-0,1 %
36-60	0,1 %	0,4 %
61-90	0,3 %	0,1 %
91-180	0,4 %	0,7 %
>180	0,6 %	0,7 %
Total	0,2 %	0,9 %

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	13 al 17 de Febrero				20 al 24 de Febrero				27 de Feb. al 3 de Marzo			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Financiero	6	126	608	480	1	98	696	361	1	141	570	294
Real	125	5	230	359	98	1	199	534	141	1	114	390
Total	131	131	839	839	99	99	896	896	142	142	684	684

* 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 15 de febrero se presenta la proyección de vencimientos.