

**Fecha de Publicación: 17 de Febrero de 2006**  
**Fecha de Información: 15 de Febrero de 2006**<sup>1</sup>

**INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS**

Según el reporte de los Intermediarios del Mercado Cambiario durante el día se pactó un total de US\$217,8 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de ,2%.<sup>2</sup>

**Cuadro No. 1**  
**Contratos Forwards Pactados**

Rango	Sector Financiero		Sector Real		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	88,1	73,7	5,7	20,1	93,8
15-35	47,3	65,0	52,0	34,3	99,3
36-60	13,0	13,1	0,1	0,0	13,1
61-90	0,0	9,4	9,4	0,0	9,4
91-180	0,0	0,9	0,9	0,0	0,9
>180	1,0	0,3	0,3	1,0	1,3
<b>Total</b>	<b>149,4</b>	<b>162,4</b>	<b>68,4</b>	<b>55,4</b>	<b>217,8</b>

\* Cifras en millones de dólares

**Cuadro No. 2**  
**Devaluación Implícita Anualizada**

Rango	Promedio Simple	Promedio Ponderado por Monto
3-14	0,4 %	0,0 %
15-35	-0,1 %	0,2 %
36-60	0,8 %	1,3 %
61-90	0,6 %	0,6 %
91-180	1,0 %	1,0 %
>180	1,1 %	0,8 %
<b>Total</b>	<b>0,4 %</b>	<b>0,2 %</b>

En el cuadro No. 3 se presentan los vencimientos de forwards para ésta y las próximas dos semanas.<sup>3</sup>

**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
<b>Financiero</b>	6	126	608	480	1	98	782	431	1	142	589	310
<b>Real</b>	125	5	230	359	98	1	204	555	142	1	114	393
<b>Total</b>	131	131	839	839	99	99	985	985	143	143	703	703

\* Cifras en millones de dólares

<sup>1</sup> Datos provisionales.

<sup>2</sup> La fórmula para la devaluación implícita es: ((Tasa Pactada/Promedio SET FX) ^ (365/Plazo)) - 1

<sup>3</sup> A partir del 16 de febrero se presenta la proyección de vencimientos.