

Fecha de Publicación: 20 de Febrero de 2006
Fecha de Información: 16 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\$143,9 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de $-0,4\%$.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero		Sector Real		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	18,8	23,0	6,0	1,8	24,8
15-35	46,6	45,0	45,0	46,6	91,6
36-60	8,2	9,0	1,0	0,2	9,2
61-90	8,8	11,4	3,4	0,8	12,2
91-180	2,0	0,0	0,0	2,0	2,0
>180	2,0	2,0	2,0	2,0	4,0
Total	86,5	90,5	57,5	53,5	143,9

* Cifras en millones de dólares

Cuadro No. 2
Devaluación Implícita Anualizada

Rango	Promedio Simple	Promedio Ponderado por Monto
3-14	-0,4 %	-0,9 %
15-35	-0,5 %	-0,5 %
36-60	0,0 %	0,2 %
61-90	0,2 %	0,4 %
91-180	-0,2 %	-0,2 %
>180	1,1 %	1,0 %
Total	-0,3 %	-0,4 %

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	125	608	480	2	98	799	454	1	142	596	310
Real	125	5	231	359	98	2	210	555	142	1	114	400
Total	130	130	839	839	100	100	1009	1009	143	143	710	710

* Cifras en millones de dólares

¹ Datos provisionales.

² La fórmula para la devaluación implícita es: $((\text{Tasa Pactada}/\text{Promedio SET FX}) \wedge (365/\text{Plazo})) - 1$

³ A partir del 17 de febrero se presenta la proyección de vencimientos.