

Fecha de Publicación: 21 de Febrero de 2006
Fecha de Información: 17 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\$116,6 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de $-0,9\%$.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero		Sector Real		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	14,1	10,0	7,0	11,1	21,1
15-35	26,1	46,3	37,3	17,1	63,4
36-60	3,2	5,3	5,3	3,2	8,5
61-90	3,0	0,9	0,9	3,0	3,9
91-180	7,5	3,2	3,2	7,5	10,7
>180	4,0	4,9	4,9	4,0	8,9
Total	57,9	70,7	58,7	45,9	116,6

* Cifras en millones de dólares

Cuadro No. 2
Devaluación Implícita Anualizada

Rango	Promedio Simple	Promedio Ponderado por Monto
3-14	0,6 %	-2,1 %
15-35	-0,7 %	-1,1 %
36-60	-0,2 %	-0,3 %
61-90	-0,1 %	-0,2 %
91-180	0,5 %	0,2 %
>180	0,9 %	0,8 %
Total	0,0 %	-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	125	608	481	2	100	809	454	1	142	599	318
Real	125	5	231	359	100	2	210	565	142	1	119	400
Total	130	130	840	840	102	102	1019	1019	143	143	718	718

* 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 20 de febrero se presenta la proyección de vencimientos.