

Fecha de Publicación: 23 de Febrero de 2006
Fecha de Información: 21 de Febrero de 2006 ¹

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Según el reporte de los Intermediarios del Mercado Cambiario durante el día se pactó un total de US\$189,4 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de $-0,3\%$.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero		Sector Real		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	41,9	40,7	8,7	9,9	50,6
15-35	58,4	33,6	23,6	48,4	82,0
36-60	10,2	4,3	4,3	10,2	14,4
61-90	1,2	2,6	2,1	0,7	3,3
91-180	22,2	0,8	0,8	22,2	23,0
>180	16,1	0,0	0,0	16,1	16,1
Total	149,9	82,0	39,5	107,4	189,4

* Cifras en millones de dólares

Cuadro No. 2
Devaluación Implícita Anualizada

Rango	Promedio Simple	Promedio Ponderado por Monto
3-14	-1,1 %	-0,8 %
15-35	-0,3 %	-0,3 %
36-60	0,2 %	-0,2 %
61-90	0,3 %	0,5 %
91-180	0,8 %	0,3 %
>180	0,8 %	0,6 %
Total	-0,2 %	-0,3 %

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	20 al 24 de Febrero				27 de Feb. al 3 de Marzo				6 al 10 de Marzo			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Financiero	2	101	819	463	1	143	619	344	2	59	341	217
Real	100	2	209	565	143	1	127	402	59	2	132	256
Total	103	103	1028	1028	144	144	745	745	61	61	474	474

* 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 22 de febrero se presenta la proyección de vencimientos.