

Fecha de Publicación: 24 de Febrero de 2006
Fecha de Información: 22 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\$353,4 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de ,3%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero		Sector Real		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	23,6	55,7	32,7	0,6	56,2
15-35	117,2	24,9	9,9	102,2	127,1
36-60	90,0	15,0	5,0	80,0	95,0
61-90	52,2	6,1	6,1	52,2	58,3
91-180	7,1	9,2	2,2	0,1	9,3
>180	5,6	1,8	1,8	5,6	7,5
Total	295,7	112,7	57,7	240,7	353,4

* Cifras en millones de dólares

Cuadro No. 2
Devaluación Implícita Anualizada

Rango	Promedio Simple	Promedio Ponderado por Monto
3-14	3,6 %	3,3 %
15-35	0,1 %	-0,9 %
36-60	0,5 %	-0,1 %
61-90	0,7 %	0,5 %
91-180	0,8 %	0,9 %
>180	1,2 %	0,7 %
Total	1,0 %	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	99	819	465	1	143	642	399	3	59	342	218
Real	99	2	211	565	143	1	159	402	59	3	133	257
Total	101	101	1030	1030	145	145	801	801	61	61	474	474

* 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 23 de febrero se presenta la proyección de vencimientos.