

**Fecha de Publicación: 28 de Febrero de 2006**  
**Fecha de Información: 24 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\$232,4 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de 0,1%.<sup>2</sup>

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

Rango	Sector Financiero		Sector Real		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	6,1	8,5	8,5	6,1	14,7
15-35	81,0	72,7	42,5	50,8	123,4
36-60	9,1	7,7	7,7	9,1	16,8
61-90	1,3	2,0	2,0	1,3	3,2
91-180	0,0	33,1	33,1	0,0	33,1
>180	34,3	9,2	6,9	32,0	41,2
<b>Total</b>	<b>131,8</b>	<b>133,1</b>	<b>100,6</b>	<b>99,3</b>	<b>232,4</b>

\* Cifras en millones de dólares

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

Rango	Promedio Simple	Promedio Ponderado por Monto
3-14	3,8 %	1,9 %
15-35	-0,3 %	-0,3 %
36-60	-0,1 %	-0,2 %
61-90	0,1 %	0,3 %
91-180	0,8 %	0,5 %
>180	1,0 %	0,7 %
<b>Total</b>	<b>0,6 %</b>	<b>0,1 %</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	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
<b>Financiero</b>	2	97	819	467	3	144	677	438	3	60	374	253
<b>Real</b>	97	2	213	565	144	3	169	408	60	3	141	262
<b>Total</b>	99	99	1032	1032	147	147	846	846	63	63	514	514

\* Cifras en millones de dólares

<sup>1</sup> Datos provisionales.

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

<sup>3</sup> A partir del 27 de febrero se presenta la proyección de vencimientos.