

Fecha de Publicación: 1 de Marzo de 2006
Fecha de Información: 27 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\$194,6 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de -1,0%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero		Sector Real		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	44,5	41,2	1,0	4,3	45,5
15-35	19,4	84,0	84,0	19,4	103,4
36-60	38,6	10,2	3,1	31,5	41,6
61-90	0,9	2,1	2,1	0,9	2,9
91-180	0,4	0,6	0,6	0,4	1,1
>180	0,0	0,0	0,0	0,0	0,1
Total	103,9	138,1	90,7	56,6	194,6

* Cifras en millones de dólares

Cuadro No. 2
Devaluación Implícita Anualizada

Rango	Promedio Simple	Promedio Ponderado por Monto
3-14	-0,9 %	-0,1 %
15-35	-1,5 %	-1,6 %
36-60	-0,9 %	-0,6 %
61-90	-0,7 %	-0,1 %
91-180	0,0 %	0,2 %
>180	0,3 %	0,1 %
Total	-0,9 %	-1,0 %

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	27 de Feb. al 3 de Marzo				6 al 10 de Marzo				13 al 17 de Marzo			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Financiero	3	142	689	451	4	60	392	271	8	137	472	259
Real	142	3	171	409	60	4	141	262	137	8	119	331
Total	145	145	860	860	64	64	533	533	145	145	590	590

* 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 28 de febrero se presenta la proyección de vencimientos.