

Fecha de Publicación: 3 de Febrero de 2006
Fecha de Información: 01 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\$205,7 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de ,4%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero		Sector Real		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	10,5	89,9	83,9	4,5	94,4
15-35	39,8	28,6	15,6	26,8	55,4
36-60	10,2	8,1	8,1	10,2	18,2
61-90	23,1	13,1	3,1	13,1	26,2
91-180	0,6	4,5	4,5	0,6	5,1
>180	2,0	4,4	4,4	2,0	6,4
Total	86,1	148,6	119,6	57,1	205,7

* Cifras en millones de dólares

Cuadro No. 2
Devaluación Implícita Anualizada

Rango	Promedio Simple	Promedio Ponderado por Monto
3-14	0,5 %	1,0 %
15-35	-0,6 %	-0,6 %
36-60	-0,2 %	-0,3 %
61-90	0,4 %	0,1 %
91-180	0,6 %	0,7 %
>180	1,3 %	1,2 %
Total	0,3 %	0,4 %

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	30 de Ene. al 3 de Febrero				6 al 10 de Febrero				13 al 17 de Febrero			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Financiero	26	97	497	347	7	92	491	419	11	123	428	393
Real	97	26	200	349	92	7	225	297	122	11	217	252
Total	123	123	697	697	99	99	715	715	134	134	645	645

* 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 2 de febrero se presenta la proyección de vencimientos.