

Fecha de Publicación: 16 de Enero de 2006
Fecha de Información: 12 de Enero 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\$226,5 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de -,2%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero		Sector Real		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	37,9	66,1	35,1	6,9	72,9
15-35	106,1	26,2	11,7	91,6	117,9
36-60	5,0	0,3	0,3	5,0	5,3
61-90	22,0	0,1	0,1	22,0	22,1
91-180	1,0	0,5	0,5	1,0	1,5
>180	2,0	4,7	4,7	2,0	6,7
Total	174,0	98,0	52,5	128,5	226,5

* Cifras en millones de dólares

Cuadro No. 2
Devaluación Implícita Anualizada

Rango	Promedio Simple	Promedio Ponderado por Monto
3-14	-0,4 %	-0,6 %
15-35	-0,1 %	-0,2 %
36-60	0,4 %	0,2 %
61-90	0,3 %	0,2 %
91-180	0,8 %	0,5 %
>180	1,2 %	1,1 %
Total	0,1 %	-0,2 %

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	9 al 13 de Enero				16 al 20 de Enero				23 al 27 de Enero			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Financiero	15	55	600	405	8	48	611	523	6	63	388	280
Real	54	15	139	334	48	8	273	361	62	5	154	263
Total	69	69	739	739	55	55	884	884	68	68	543	543

* 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 13 de enero se presenta la proyección de vencimientos.