

Fecha de Publicación: 31 de Enero de 2006
Fecha de Información: 27 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\$155,3 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de $-0,5\%$.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero		Sector Real		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	3,8	4,5	4,5	3,8	8,3
15-35	69,8	40,4	33,4	62,8	103,2
36-60	2,8	20,4	20,4	2,8	23,2
61-90	0,0	1,5	1,5	0,0	1,5
91-180	16,0	2,5	2,5	16,0	18,5
>180	0,0	0,5	0,5	0,0	0,5
Total	92,5	69,8	62,8	85,5	155,3

* Cifras en millones de dólares

Cuadro No. 2
Devaluación Implícita Anualizada

Rango	Promedio Simple	Promedio Ponderado por Monto
3-14	3,2 %	-3,4 %
15-35	-0,2 %	-0,3 %
36-60	-0,9 %	-0,2 %
61-90	0,9 %	0,8 %
91-180	0,2 %	-0,8 %
>180	1,5 %	1,4 %
Total	0,4 %	-0,5 %

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	23 al 27 de Enero				30 de Ene. al 3 de Febrero				6 al 10 de Febrero			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Financiero	31	68	560	421	26	92	490	347	7	92	458	351
Real	68	30	211	350	92	26	200	343	92	7	163	270
Total	98	98	771	771	118	118	690	690	99	99	620	620

* Cifras en millones de dólares

¹ Datos provisionales.

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

³ A partir del 30 de enero se presenta la proyección de vencimientos.