

Fecha de Publicación: 10 de Enero de 2006
Fecha de Información: 05 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\$202,1 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de ,1%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero		Sector Real		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	33,3	35,9	8,9	6,3	42,2
15-35	69,0	47,1	37,1	59,0	106,1
36-60	23,0	10,7	0,7	13,0	23,7
61-90	18,0	4,9	4,9	18,0	22,9
91-180	2,3	1,7	1,7	2,3	4,1
>180	2,5	0,7	0,7	2,5	3,2
Total	148,1	101,0	54,0	101,1	202,1

* Cifras en millones de dólares

Cuadro No. 2
Devaluación Implícita Anualizada

Rango	Promedio Simple	Promedio Ponderado por Monto
3-14	-1,4 %	-1,7 %
15-35	0,4 %	0,6 %
36-60	0,7 %	0,6 %
61-90	0,7 %	0,6 %
91-180	0,8 %	0,7 %
>180	1,3 %	1,3 %
Total	-0,1 %	0,1 %

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				2 al 6 de Enero			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Financiero	14	55	541	346	3	48	531	435	4	47	457	372
Real	54	13	139	335	48	3	252	347	47	4	178	263
Total	68	68	681	681	51	51	783	783	50	50	635	635

* 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 6 de enero se presenta la proyección de vencimientos.