

Fecha de Publicación: 12 de Enero de 2006
Fecha de Información: 10 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\$315,1 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de ,0%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

| Rango | Sector Financiero | | Sector Real | | Total |
|--------------|-------------------|--------------|-------------|-------------|--------------|
| | Compras | Ventas | Compras | Ventas | |
| 3-14 | 101,4 | 91,0 | 0,0 | 10,4 | 101,5 |
| 15-35 | 79,9 | 110,4 | 48,4 | 17,9 | 128,3 |
| 36-60 | 10,0 | 12,2 | 2,2 | 0,0 | 12,2 |
| 61-90 | 33,0 | 3,1 | 3,1 | 33,0 | 36,1 |
| 91-180 | 8,1 | 21,9 | 21,9 | 8,1 | 30,0 |
| >180 | 2,9 | 4,2 | 4,2 | 2,9 | 7,1 |
| Total | 235,4 | 242,8 | 79,8 | 72,4 | 315,1 |

* Cifras en millones de dólares

Cuadro No. 2
Devaluación Implícita Anualizada

| Rango | Promedio Simple | Promedio Ponderado por Monto |
|--------------|-----------------|------------------------------|
| 3-14 | -0,2 % | -1,0 % |
| 15-35 | 0,2 % | 0,3 % |
| 36-60 | 0,8 % | 0,5 % |
| 61-90 | 0,8 % | 0,3 % |
| 91-180 | 0,8 % | 0,7 % |
| >180 | 1,3 % | 1,2 % |
| Total | 0,5 % | 0,0 % |

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 | 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 | 4 | 48 | 576 | 469 | 5 | 63 | 350 | 232 |
| Real | 54 | 15 | 139 | 334 | 48 | 4 | 253 | 360 | 62 | 4 | 137 | 255 |
| Total | 69 | 69 | 739 | 739 | 52 | 52 | 829 | 829 | 67 | 67 | 487 | 487 |

* 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 11 de enero se presenta la proyección de vencimientos.