

Fecha de Publicación: 17 de Enero de 2006
Fecha de Información: 13 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\$153,2 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de ,7%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero		Sector Real		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	43,2	7,0	7,0	43,2	50,2
15-35	43,8	28,9	16,9	31,8	60,6
36-60	5,0	10,2	5,2	0,0	10,2
61-90	12,5	1,2	1,2	12,5	13,7
91-180	7,4	7,6	0,6	0,4	8,1
>180	0,0	10,4	10,4	0,0	10,4
Total	111,9	65,3	41,3	87,9	153,2

* Cifras en millones de dólares

Cuadro No. 2
Devaluación Implícita Anualizada

Rango	Promedio Simple	Promedio Ponderado por Monto
3-14	6,4 %	0,5 %
15-35	0,5 %	1,0 %
36-60	0,3 %	0,3 %
61-90	0,2 %	0,0 %
91-180	0,9 %	1,1 %
>180	1,5 %	1,4 %
Total	1,7 %	0,7 %

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	9	48	623	528	6	63	418	282
Real	54	15	139	334	48	9	278	373	62	5	156	293
Total	69	69	739	739	57	57	901	901	68	68	575	575

* 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 16 de enero se presenta la proyección de vencimientos.