

Fecha de Publicación: 18 de Enero de 2006
Fecha de Información: 16 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\$157,1 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de -2,0%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero		Sector Real		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	24,0	50,0	50,0	24,0	74,0
15-35	42,3	27,1	27,1	42,3	69,4
36-60	0,5	4,2	4,2	0,5	4,7
61-90	0,1	2,2	2,2	0,1	2,2
91-180	4,0	2,8	2,8	4,0	6,8
>180	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
Total	70,9	86,2	86,2	70,9	157,1

* Cifras en millones de dólares

Cuadro No. 2
Devaluación Implícita Anualizada

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

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

Sector	16 al 20 de Enero				23 al 27 de Enero				30 de Ene. al 3 de Febrero			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Financiero	9	48	623	568	6	63	441	289	3	54	325	240
Real	48	9	318	373	62	5	163	316	54	3	145	230
Total	57	57	941	941	68	68	605	605	57	57	470	470

* 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 17 de enero se presenta la proyección de vencimientos.