

Fecha de Publicación: 19 de Enero de 2006
Fecha de Información: 17 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\$224,9 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de ,4%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero		Sector Real		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	54,2	31,7	7,7	30,2	61,8
15-35	45,5	51,3	40,3	34,5	85,8
36-60	6,0	23,1	18,1	1,0	24,1
61-90	25,5	16,6	6,6	15,5	32,1
91-180	3,7	16,6	16,6	3,7	20,3
>180	0,7	0,1	0,1	0,7	0,8
Total	135,6	139,2	89,2	85,6	224,9

* Cifras en millones de dólares

Cuadro No. 2
Devaluación Implícita Anualizada

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

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	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	14	48	629	578	9	63	467	306	3	54	346	243
Real	48	14	323	373	63	8	166	327	54	3	145	248
Total	61	61	951	951	71	71	633	633	57	57	491	491

* 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 18 de enero se presenta la proyección de vencimientos.