

Fecha de Publicación: 23 de Enero de 2006
Fecha de Información: 19 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\$154,5 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de ,6%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero		Sector Real		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	31,6	25,6	25,6	31,6	57,2
15-35	40,0	38,0	23,0	25,0	63,0
36-60	6,2	9,8	4,3	0,7	10,5
61-90	6,0	12,7	7,2	0,5	13,2
91-180	7,3	0,7	0,7	7,3	8,1
>180	0,0	2,6	2,6	0,0	2,6
Total	91,1	89,3	63,3	65,1	154,5

* Cifras en millones de dólares

Cuadro No. 2
Devaluación Implícita Anualizada

Rango	Promedio Simple	Promedio Ponderado por Monto
3-14	1,1 %	1,1 %
15-35	0,2 %	0,0 %
36-60	0,5 %	0,7 %
61-90	1,0 %	1,3 %
91-180	0,6 %	0,1 %
>180	1,6 %	2,2 %
Total	0,8 %	0,6 %

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	14	47	629	579	27	68	512	373	6	72	354	260
Real	47	14	323	373	67	26	207	345	72	6	157	251
Total	60	60	952	952	94	94	719	719	78	78	511	511

* 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 20 de enero se presenta la proyección de vencimientos.