

Fecha de Publicación: 27 de Enero de 2006
Fecha de Información: 25 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\$303,9 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de -1,8%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero		Sector Real		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	21,5	42,0	30,0	9,5	51,5
15-35	103,9	53,4	31,4	81,9	135,3
36-60	12,6	37,2	27,2	2,6	39,8
61-90	10,5	7,1	7,1	10,5	17,6
91-180	27,3	3,4	3,4	27,3	30,6
>180	13,8	15,4	15,4	13,8	29,2
Total	189,4	158,5	114,5	145,4	303,9

* Cifras en millones de dólares

Cuadro No. 2
Devaluación Implícita Anualizada

Rango	Promedio Simple	Promedio Ponderado por Monto
3-14	-2,1 %	-7,3 %
15-35	-1,9 %	-1,4 %
36-60	-0,7 %	0,9 %
61-90	-0,7 %	-1,2 %
91-180	-0,3 %	-0,3 %
>180	0,2 %	0,2 %
Total	-0,7 %	-1,8 %

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	23 al 27 de Enero				30 de Ene. al 3 de Febrero				6 al 10 de Febrero			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Financiero	31	68	560	421	12	92	436	335	6	90	438	332
Real	68	30	211	350	92	12	200	300	90	6	160	266
Total	98	98	771	771	104	104	636	636	96	96	597	597

* 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 26 de enero se presenta la proyección de vencimientos.