

Fecha de Publicación: 30 de Enero de 2006
Fecha de Información: 26 de Enero de 2006 ¹

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Según el reporte de los Intermediarios del Mercado Cambiario durante el día se pactó un total de US\$411,2 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de $-0,9\%$.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero		Sector Real		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	72,9	16,0	0,0	56,9	72,9
15-35	117,3	200,0	128,0	45,3	245,3
36-60	9,4	18,0	18,0	9,4	27,4
61-90	16,8	25,1	25,1	16,8	41,9
91-180	11,4	3,3	3,3	11,4	14,8
>180	1,8	7,2	7,2	1,8	9,0
Total	229,6	269,6	181,6	141,6	411,2

* Cifras en millones de dólares

Cuadro No. 2
Devaluación Implícita Anualizada

Rango	Promedio Simple	Promedio Ponderado por Monto
3-14	-2,5 %	-2,6 %
15-35	-1,0 %	-0,8 %
36-60	-0,8 %	0,3 %
61-90	-0,4 %	0,1 %
91-180	0,1 %	-0,1 %
>180	0,7 %	0,6 %
Total	-0,8 %	-0,9 %

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	23	92	489	347	7	91	457	348
Real	68	30	211	350	92	23	200	342	91	7	160	269
Total	98	98	771	771	115	115	689	689	98	98	617	617

* Cifras en millones de dólares

¹ Datos provisionales.

² La fórmula para la devaluación implícita es: $((\text{Tasa Pactada}/\text{Promedio SET FX}) \wedge (365/\text{Plazo})) - 1$

³ A partir del 27 de enero se presenta la proyección de vencimientos.