

Fecha de Publicación: 01 de Febrero de 2006
Fecha de Información: 30 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\$163,4 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de $-0,2\%$.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero		Sector Real		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	17,6	6,0	0,0	11,6	17,6
15-35	59,0	69,2	62,2	52,0	121,2
36-60	11,6	8,0	2,0	5,6	13,6
61-90	0,0	1,7	1,7	0,0	1,7
91-180	3,4	3,7	3,7	3,4	7,0
>180	2,0	0,3	0,3	2,0	2,3
Total	93,6	88,8	69,8	74,6	163,4

* Cifras en millones de dólares

Cuadro No. 2
Devaluación Implícita Anualizada

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

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	30 de Ene. al 3 de Febrero				6 al 10 de Febrero				13 al 17 de Febrero			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Financiero	26	92	497	347	7	92	469	357	11	121	415	334
Real	92	26	200	349	92	7	163	275	121	11	163	245
Total	118	118	697	697	99	99	631	631	132	132	579	579

* 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 31 de enero se presenta la proyección de vencimientos.