

Fecha de Publicación: 4 de Enero de 2006
Fecha de Información: 02 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\$7,3 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de -,1%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero		Sector Real		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	2,5	0,2	0,2	2,5	2,8
15-35	0,1	0,0	0,0	0,1	0,1
36-60	4,0	0,1	0,1	4,0	4,1
61-90	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
91-180	0,0	0,3	0,3	0,0	0,3
>180	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
Total	6,6	0,7	0,7	6,6	7,3

* Cifras en millones de dólares

Cuadro No. 2
Devaluación Implícita Anualizada

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

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	9 al 13 de Enero				16 al 20 de Enero				2 al 6 de Enero			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Financiero	13	60	511	319	3	48	476	391	4	47	457	372
Real	60	13	124	315	48	3	252	337	47	4	177	263
Total	73	73	634	634	50	50	728	728	51	51	635	635

* 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 3 de enero se presenta la proyección de vencimientos.