

Fecha de Publicación: 06 de Diciembre de 2005
Fecha de Información: 02 de Diciembre de 2005 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\$264,5 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de ,5%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero		Sector Real		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	35,3	33,8	13,8	15,3	49,1
15-35	63,5	37,3	17,2	43,4	80,7
36-60	37,7	11,2	6,1	32,6	43,8
61-90	22,2	24,2	2,2	0,2	24,4
91-180	33,0	21,7	6,7	18,0	39,7
>180	0,1	26,6	26,6	0,1	26,7
Total	191,8	154,9	72,7	109,6	264,5

* Cifras en millones de dólares

Cuadro No. 2
Devaluación Implícita Anualizada

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

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	28 de Nov. al 2 de Diciembre				5 al 9 de Diciembre				12 al 16 de Diciembre			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Financiero	20	95	554	344	5	104	678	648	18	104	654	504
Real	87	12	152	362	103	5	342	372	104	18	365	516
Total	107	107	705	705	108	108	1019	1019	123	123	1020	1020

* 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 5 de diciembre se presenta la proyección de vencimientos.