

Fecha de Publicación: 07 de Diciembre de 2005
Fecha de Información: 05 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\$111,2 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de $-0,1\%$.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero		Sector Real		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	6,6	4,1	4,1	6,6	10,7
15-35	68,5	10,2	10,2	68,5	78,7
36-60	0,1	9,6	9,6	0,1	9,7
61-90	1,9	2,3	2,3	1,9	4,2
91-180	1,0	2,0	1,0	0,0	2,0
>180	5,0	0,9	0,9	5,0	5,9
Total	83,2	29,0	28,0	82,2	111,2

* Cifras en millones de dólares

Cuadro No. 2
Devaluación Implícita Anualizada

Rango	Promedio Simple	Promedio Ponderado por Monto
3-14	-0,2 %	-0,1 %
15-35	-0,2 %	-0,3 %
36-60	0,3 %	0,4 %
61-90	0,6 %	0,6 %
91-180	1,1 %	1,0 %
>180	1,1 %	0,2 %
Total	0,2 %	-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	5 al 9 de Diciembre				12 al 16 de Diciembre				19 al 23 de Diciembre			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Financiero	5	81	678	653	18	107	661	506	5	83	342	298
Real	80	4	347	372	106	18	367	522	83	4	166	210
Total	85	85	1025	1025	125	125	1028	1028	88	88	508	508

* 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 6 de diciembre se presenta la proyección de vencimientos.