

Fecha de Publicación: 09 de Diciembre de 2005
Fecha de Información: 06 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\$124,4 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de ,3%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero		Sector Real		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	24,0	17,0	17,0	24,0	41,0
15-35	21,0	35,2	33,7	19,5	54,7
36-60	0,1	2,0	2,0	0,1	2,1
61-90	16,5	3,3	3,3	16,5	19,8
91-180	0,0	1,6	1,5	0,0	1,6
>180	2,0	3,3	3,3	2,0	5,3
Total	63,6	62,3	60,8	62,1	124,4

* Cifras en millones de dólares

Cuadro No. 2
Devaluación Implícita Anualizada

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

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	677	653	19	107	664	513	5	83	378	308
Real	80	5	347	371	106	19	374	525	83	4	176	246
Total	85	85	1024	1024	125	125	1038	1038	88	88	554	554

* 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 7 de diciembre se presenta la proyección de vencimientos.