

Fecha de Publicación: 12 de Diciembre de 2005
Fecha de Información: 07 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\$220,3 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de ,4%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero		Sector Real		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	45,6	49,2	49,2	45,6	94,9
15-35	26,0	75,1	69,8	20,7	95,8
36-60	0,2	8,4	8,2	0,0	8,4
61-90	2,4	3,1	1,3	0,6	3,7
91-180	0,0	4,2	4,2	0,0	4,2
>180	0,0	13,2	13,2	0,0	13,2
Total	74,3	153,3	146,0	67,0	220,3

* Cifras en millones de dólares

Cuadro No. 2
Devaluación Implícita Anualizada

Rango	Promedio Simple	Promedio Ponderado por Monto
3-14	0,7 %	0,4 %
15-35	0,0 %	0,3 %
36-60	0,6 %	0,5 %
61-90	0,8 %	0,5 %
91-180	1,2 %	1,1 %
>180	1,5 %	1,3 %
Total	0,7 %	0,4 %

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	680	653	19	107	705	535	5	92	386	331
Real	80	5	347	374	106	19	396	566	92	4	194	249
Total	85	85	1027	1027	126	126	1101	1101	97	97	579	579

* 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 8 de diciembre se presenta la proyección de vencimientos.