

Fecha de Publicación: 13 de Diciembre de 2005
Fecha de Información: 09 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\$185,8 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	22,5	0,9	0,9	22,5	23,4
15-35	97,6	94,2	39,2	42,6	136,8
36-60	1,5	16,3	14,8	0,0	16,3
61-90	3,0	3,1	3,1	3,0	6,1
91-180	0,1	0,8	0,7	0,0	0,8
>180	0,0	2,4	2,4	0,0	2,4
Total	124,7	117,7	61,0	68,1	185,8

* Cifras en millones de dólares

Cuadro No. 2
Devaluación Implícita Anualizada

Rango	Promedio Simple	Promedio Ponderado por Monto
3-14	-0,1 %	-0,2 %
15-35	0,1 %	0,1 %
36-60	0,6 %	0,3 %
61-90	0,8 %	0,6 %
91-180	1,1 %	1,1 %
>180	1,8 %	1,9 %
Total	0,3 %	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	680	653	19	105	706	538	5	93	407	330
Real	80	5	347	374	104	19	399	567	93	5	193	270
Total	85	85	1027	1027	124	124	1105	1105	97	97	600	600

* 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 12 de diciembre se presenta la proyección de vencimientos.