

Fecha de Publicación: 14 de Diciembre de 2005
Fecha de Información: 12 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\$129,7 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de ,2%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero		Sector Real		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	47,8	59,9	15,9	3,8	63,8
15-35	19,0	25,7	13,7	7,0	32,8
36-60	18,1	25,9	7,9	0,1	26,0
61-90	0,6	1,4	1,4	0,6	2,0
91-180	0,6	1,8	1,8	0,6	2,4
>180	0,3	2,4	2,4	0,3	2,8
Total	86,5	117,3	43,3	12,5	129,7

* Cifras en millones de dólares

Cuadro No. 2
Devaluación Implícita Anualizada

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

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

Sector	12 al 16 de Diciembre				19 al 23 de Diciembre				26 al 30 de Diciembre			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Financiero	19	105	725	562	5	93	435	366	2	72	427	256
Real	104	19	405	568	93	5	203	272	72	1	127	298
Total	124	124	1131	1131	97	97	638	638	74	74	554	554

* 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 13 de diciembre se presenta la proyección de vencimientos.