

Fecha de Publicación: 19 de Diciembre de 2005
Fecha de Información: 15 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\$260,1 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	59,8	27,3	1,8	34,3	61,6
15-35	74,1	76,0	49,5	47,6	123,6
36-60	6,3	25,8	25,7	6,2	31,9
61-90	17,5	15,2	15,2	17,5	32,7
91-180	5,3	3,7	3,7	5,3	9,1
>180	0,0	1,1	1,1	0,0	1,1
Total	163,0	149,2	97,1	110,9	260,1

* Cifras en millones de dólares

Cuadro No. 2
Devaluación Implícita Anualizada

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

Sectores	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	23	103	726	562	28	99	573	438	2	81	506	300
Real	103	23	405	569	98	28	220	354	81	1	131	336
Total	125	125	1130	1130	126	126	792	792	82	82	637	637

* 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 16 de diciembre se presenta la proyección de vencimientos.