

Fecha de Publicación: 22 de Diciembre de 2005
Fecha de Información: 20 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\$175,0 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de $-0,2\%$.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero		Sector Real		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	33,0	31,8	1,8	3,0	34,8
15-35	78,8	22,8	12,8	68,8	91,7
36-60	9,8	12,9	12,9	9,8	22,7
61-90	1,9	2,4	2,4	1,9	4,3
91-180	14,4	4,6	4,6	14,3	19,0
>180	1,0	1,6	1,6	1,0	2,6
Total	138,9	76,2	36,1	98,8	175,0

* Cifras en millones de dólares

Cuadro No. 2
Devaluación Implícita Anualizada

Rango	Promedio Simple	Promedio Ponderado por Monto
3-14	-1,3 %	-1,2 %
15-35	0,0 %	-0,2 %
36-60	0,0 %	0,7 %
61-90	0,0 %	0,2 %
91-180	0,5 %	0,7 %
>180	1,1 %	1,1 %
Total	0,3 %	-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	19 al 23 de Diciembre				26 al 30 de Diciembre				2 al 6 de Enero			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Financiero	29	98	642	530	2	80	549	397	1	47	317	216
Real	98	29	247	359	80	2	197	349	46	1	133	234
Total	127	127	889	889	81	81	746	746	48	48	450	450

* 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 21 de diciembre se presenta la proyección de vencimientos.