

Fecha de Publicación: 27 de Diciembre de 2005
Fecha de Información: 23 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\$217,9 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de -0,3%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero		Sector Real		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	42,5	51,2	14,2	5,5	56,7
15-35	66,4	85,9	53,9	34,4	120,3
36-60	9,9	14,3	9,3	4,9	19,3
61-90	0,2	2,5	2,5	0,2	2,7
91-180	1,7	2,3	2,3	1,7	4,1
>180	12,3	14,5	2,5	0,3	14,8
Total	133,0	170,8	84,8	47,0	217,9

* Cifras en millones de dólares

Cuadro No. 2
Devaluación Implícita Anualizada

Rango	Promedio Simple	Promedio Ponderado por Monto
3-14	-1,1 %	-1,2 %
15-35	-0,4 %	-0,4 %
36-60	0,6 %	1,0 %
61-90	0,6 %	0,4 %
91-180	0,9 %	0,8 %
>180	1,6 %	2,0 %
Total	-0,1 %	-0,3 %

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	82	576	421	4	47	397	309
Real	98	29	247	359	82	2	202	358	46	3	152	239
Total	127	127	889	889	84	84	778	778	50	50	549	549

* 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 26 de diciembre se presenta la proyección de vencimientos.