

Fecha de Publicación: 28 de Diciembre de 2005
Fecha de Información: 26 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\$34,5 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	9,0	9,1	4,1	4,0	13,1
15-35	11,0	6,3	1,3	6,0	12,3
36-60	3,0	1,7	1,7	3,0	4,7
61-90	0,1	4,1	4,0	0,0	4,1
91-180	0,0	0,4	0,4	0,0	0,4
>180	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
Total	23,1	21,5	11,4	13,0	34,5

* Cifras en millones de dólares

Cuadro No. 2
Devaluación Implícita Anualizada

Rango	Promedio Simple	Promedio Ponderado por Monto
3-14	-1,4 %	-1,2 %
15-35	0,4 %	0,1 %
36-60	0,4 %	0,3 %
61-90	1,0 %	1,0 %
91-180	1,0 %	1,1 %
>180	-	-
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	26 al 30 de Diciembre				2 al 6 de Enero				9 al 13 de Enero			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Financiero	2	85	576	421	4	47	406	315	9	61	481	299
Real	85	2	202	358	46	3	153	243	61	9	121	303
Total	87	87	778	778	50	50	559	559	70	70	602	602

* 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 27 de diciembre se presenta la proyección de vencimientos.