

Fecha de Publicación: 02 de Enero de 2006
Fecha de Información: 28 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\$193,3 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de ,5%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero		Sector Real		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	17,1	20,4	5,4	2,1	22,5
15-35	64,3	15,9	7,9	56,3	72,2
36-60	15,1	0,0	0,0	15,1	15,1
61-90	43,1	8,5	8,5	43,1	51,6
91-180	3,6	25,5	25,5	3,6	29,1
>180	0,0	2,8	2,8	0,0	2,8
Total	143,1	73,2	50,2	120,1	193,3

* Cifras en millones de dólares

Cuadro No. 2
Devaluación Implícita Anualizada

Rango	Promedio Simple	Promedio Ponderado por Monto
3-14	-0,8 %	0,4 %
15-35	0,3 %	0,2 %
36-60	0,0 %	0,4 %
61-90	0,7 %	0,7 %
91-180	1,2 %	0,9 %
>180	1,8 %	1,6 %
Total	0,4 %	0,5 %

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	420	4	47	434	360	11	61	498	307
Real	85	2	202	358	46	3	176	251	61	11	121	312
Total	87	87	778	778	50	50	611	611	72	72	619	619

* Cifras en millones de dólares

¹ Datos provisionales.

² La fórmula para la devaluación implícita es: ((Tasa Pactada/Promedio SET FX) ^ (365/Plazo)) - 1

³ A partir del 29 de diciembre se presenta la proyección de vencimientos.