

Fecha de Publicación: 3 de Enero de 2006
Fecha de Información: 29 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\$122,7 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de $-0,5\%$.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero		Sector Real		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	34,6	21,7	1,0	13,9	35,6
15-35	27,4	36,7	29,4	20,1	56,8
36-60	10,8	5,8	0,3	5,3	11,2
61-90	7,2	5,0	0,0	2,2	7,2
91-180	6,9	2,1	2,1	6,9	9,0
>180	2,6	0,3	0,3	2,6	2,9
Total	89,5	71,6	33,2	51,1	122,7

* Cifras en millones de dólares

Cuadro No. 2
Devaluación Implícita Anualizada

Rango	Promedio Simple	Promedio Ponderado por Monto
3-14	-0,7 %	-3,2 %
15-35	0,2 %	0,3 %
36-60	0,3 %	1,0 %
61-90	0,7 %	0,9 %
91-180	0,8 %	0,9 %
>180	1,6 %	1,6 %
Total	0,5 %	-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	457	372	11	61	509	317
Real	85	2	202	358	46	4	177	263	61	11	121	313
Total	87	87	778	778	50	50	635	635	72	72	630	630

* 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 30 de diciembre se presenta la proyección de vencimientos.