

Fecha de Publicación: 10 de Noviembre de 2005
Fecha de Información: 08 de Noviembre 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\$155,4 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de 1,0%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero		Sector Real		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	25,9	29,5	11,5	7,9	37,4
15-35	29,0	39,8	39,8	29,0	68,8
36-60	0,3	9,0	9,0	0,3	9,2
61-90	32,6	25,5	3,5	10,6	36,1
91-180	0,1	2,7	2,7	0,1	2,9
>180	-	1,0	1,0	-	1,0
Total	87,8	107,6	67,6	47,8	155,4

* Cifras en millones de dólares

Cuadro No. 2
Devaluación Implícita Anualizada

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

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

Sector	7 al 11 de Noviembre				14 al 18 de Noviembre				21 al 25 de Noviembre			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Financiero	10	101	479	492	29	84	613	482	7	92	631	382
Real	101	10	353	340	84	29	292	423	91	7	245	494
Total	112	112	832	832	112	112	905	905	99	99	876	876

* 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 9 de noviembre se presenta la proyección de vencimientos.