

Fecha de Publicación: 11 de Noviembre de 2005
Fecha de Información: 09 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\$337,1 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de 1,2%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero		Sector Real		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	4,2	0,5	0,5	4,2	4,7
15-35	122,0	155,2	145,1	111,9	267,1
36-60	3,0	10,1	7,1	-	10,1
61-90	10,5	13,0	7,0	4,5	17,5
91-180	12,5	27,6	25,1	10,0	37,6
>180	-	0,2	0,2	-	0,2
Total	152,2	206,6	184,9	130,6	337,1

* Cifras en millones de dólares

Cuadro No. 2
Devaluación Implícita Anualizada

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

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	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	32	84	614	482	8	92	631	382
Real	101	10	353	340	84	32	292	423	91	7	245	494
Total	111	111	832	832	116	116	906	906	99	99	876	876

* 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 10 de noviembre se presenta la proyección de vencimientos.