

Fecha de Publicación: 16 de Noviembre de 2005
Fecha de Información: 11 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\$94,6 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de ,2%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero		Sector Real		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	22,6	15,5	0,5	7,6	23,1
15-35	54,8	41,5	6,5	19,8	61,3
36-60	1,0	0,7	0,7	1,0	1,7
61-90	2,4	0,6	0,6	2,4	3,0
91-180	0,6	4,8	4,7	0,5	5,3
>180	-	0,2	0,2	-	0,2
Total	81,4	63,3	13,2	31,3	94,6

* Cifras en millones de dólares

Cuadro No. 2
Devaluación Implícita Anualizada

Rango	Promedio Simple	Promedio Ponderado por Monto
3-14	0,9 %	0,0 %
15-35	0,5 %	0,1 %
36-60	1,0 %	0,7 %
61-90	1,2 %	0,9 %
91-180	1,9 %	1,9 %
>180	2,3 %	2,3 %
Total	1,0 %	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	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	34	84	654	515	12	92	651	404
Real	101	10	353	340	84	34	295	433	91	11	248	494
Total	111	111	832	832	118	118	948	948	103	103	899	899

* 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 14 de noviembre se presenta la proyección de vencimientos.