

Fecha de Publicación: 17 de Noviembre de 2005
Fecha de Información: 15 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\$134,1 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de ,0%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero		Sector Real		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	4,3	10,6	10,6	4,3	14,9
15-35	40,1	51,3	51,3	40,1	91,4
36-60	1,0	0,6	0,6	1,0	1,6
61-90	13,4	4,8	4,8	13,4	18,2
91-180	0,0	2,3	2,3	0,0	2,3
>180	0,0	5,7	5,7	0,0	5,7
Total	58,8	75,2	75,2	58,8	134,1

* Cifras en millones de dólares

Cuadro No. 2
Devaluación Implícita Anualizada

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

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

Sectores	14 al 18 de Noviembre				21 al 25 de Noviembre				28 de Nov. al 2 de Diciembre			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Financiero	34	84	654	525	15	92	652	405	12	92	411	239
Real	84	34	305	433	91	14	248	495	85	5	136	308
Total	118	118	958	958	106	106	900	900	97	97	547	547

* 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 16 de noviembre se presenta la proyección de vencimientos.