

Fecha de Publicación: 21 de Noviembre de 2005
Fecha de Información: 17 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\$137,6 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de ,5%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero		Sector Real		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	2,9	17,3	16,3	1,9	19,2
15-35	63,6	42,6	29,1	50,1	92,7
36-60	3,4	1,0	1,0	3,4	4,4
61-90	10,5	5,7	5,7	10,5	16,2
91-180	4,3	0,4	0,4	4,3	4,7
>180	0,3	0,2	0,2	0,3	0,5
Total	85,0	67,1	52,6	70,5	137,6

* Cifras en millones de dólares

Cuadro No. 2
Devaluación Implícita Anualizada

Rango	Promedio Simple	Promedio Ponderado por Monto
3-14	0,1 %	0,7 %
15-35	0,4 %	0,4 %
36-60	0,4 %	0,3 %
61-90	0,8 %	0,9 %
91-180	0,6 %	0,8 %
>180	1,4 %	1,3 %
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	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	37	84	654	523	13	92	655	438	12	92	419	246
Real	84	37	303	433	91	12	282	498	85	5	136	309
Total	121	121	956	956	104	104	936	936	97	97	555	555

* 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 18 de noviembre se presenta la proyección de vencimientos.