

Fecha de Publicación: 23 de Noviembre de 2005
Fecha de Información: 21 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\$210,8 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de ,4%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero		Sector Real		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	72,5	57,0	10,5	26,0	83,0
15-35	48,4	66,5	55,5	37,4	104,0
36-60	7,0	12,1	6,6	1,5	13,6
61-90	3,4	5,3	5,3	3,4	8,8
91-180	0,0	1,2	1,2	0,0	1,2
>180	0,0	0,1	0,1	0,0	0,1
Total	131,4	142,4	79,3	68,4	210,8

* Cifras en millones de dólares

Cuadro No. 2
Devaluación Implícita Anualizada

Rango	Promedio Simple	Promedio Ponderado por Monto
3-14	-0,6 %	-0,2 %
15-35	0,8 %	0,8 %
36-60	0,8 %	1,5 %
61-90	1,3 %	1,0 %
91-180	1,3 %	0,9 %
>180	2,1 %	1,8 %
Total	0,6 %	0,4 %

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	21 al 25 de Noviembre				28 de Nov. al 2 de Diciembre				5 al 9 de Diciembre			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Financiero	13	102	685	459	14	92	465	272	4	103	436	477
Real	101	13	283	508	85	7	136	330	102	4	336	294
Total	115	115	967	967	99	99	602	602	106	106	772	772

* 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 22 de noviembre se presenta la proyección de vencimientos.