

Fecha de Publicación: 24 de Noviembre de 2005
Fecha de Información: 22 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\$197,6 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de ,3%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero		Sector Real		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	59,1	31,1	1,1	29,1	60,2
15-35	62,5	71,8	41,8	32,5	104,3
36-60	5,2	3,6	3,5	5,1	8,7
61-90	18,6	1,0	1,0	18,6	19,6
91-180	1,3	3,0	3,0	1,3	4,3
>180	0,0	0,5	0,5	0,0	0,5
Total	146,8	111,0	50,9	86,7	197,6

* Cifras en millones de dólares

Cuadro No. 2
Devaluación Implícita Anualizada

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

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	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	690	465	15	92	476	283	4	103	491	502
Real	101	13	283	509	85	8	137	330	102	4	336	325
Total	115	115	973	973	100	100	613	613	106	106	827	827

* 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 23 de noviembre se presenta la proyección de vencimientos.