

Fecha de Publicación: 25 de Noviembre de 2005
Fecha de Información: 23 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\$398,7 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de ,7%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero		Sector Real		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	60,0	35,8	0,3	24,5	60,3
15-35	126,8	44,6	29,6	111,8	156,4
36-60	20,0	5,3	5,3	20,0	25,3
61-90	148,8	19,5	3,5	132,8	152,3
91-180	0,0	4,3	4,3	0,0	4,3
>180	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
Total	355,7	109,5	43,0	289,2	398,7

* Cifras en millones de dólares

Cuadro No. 2
Devaluación Implícita Anualizada

Rango	Promedio Simple	Promedio Ponderado por Monto
3-14	1,9 %	2,0 %
15-35	0,5 %	0,3 %
36-60	1,0 %	0,6 %
61-90	0,8 %	0,7 %
91-180	1,0 %	1,0 %
>180	2,2 %	2,2 %
Total	1,1 %	0,7 %

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	20	93	491	292	4	103	541	529
Real	101	13	283	509	85	12	137	336	102	4	336	348
Total	115	115	973	973	105	105	628	628	106	106	877	877

* 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 24 de noviembre se presenta la proyección de vencimientos.