

Fecha de Publicación: 28 de Noviembre de 2005
Fecha de Información: 24 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\$147,1 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de ,2%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero		Sector Real		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	33,1	30,2	0,2	3,1	33,3
15-35	44,6	45,1	7,1	6,6	51,7
36-60	20,0	19,9	9,9	10,0	29,9
61-90	32,0	25,1	0,1	7,0	32,1
91-180	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
>180	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
Total	129,7	120,4	17,4	26,7	147,1

* Cifras en millones de dólares

Cuadro No. 2
Devaluación Implícita Anualizada

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

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	509	307	4	103	556	544
Real	101	13	283	508	85	12	137	339	102	4	336	348
Total	115	115	973	973	105	105	646	646	107	107	893	893

* 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 25 de noviembre se presenta la proyección de vencimientos.