

Fecha de Publicación: 29 de Noviembre de 2005
Fecha de Información: 25 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\$196,9 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de 1,3%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero		Sector Real		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	27,6	24,0	4,0	7,6	31,5
15-35	64,7	125,2	74,2	13,7	138,9
36-60	2,0	7,3	6,4	1,1	8,4
61-90	2,4	8,5	8,5	2,4	10,8
91-180	0,0	6,9	6,9	0,0	6,9
>180	0,0	0,3	0,3	0,0	0,3
Total	96,6	172,1	100,2	24,8	196,9

* Cifras en millones de dólares

Cuadro No. 2
Devaluación Implícita Anualizada

Rango	Promedio Simple	Promedio Ponderado por Monto
3-14	2,9 %	2,4 %
15-35	1,0 %	1,1 %
36-60	1,1 %	1,2 %
61-90	1,3 %	1,2 %
91-180	1,4 %	1,5 %
>180	1,5 %	1,7 %
Total	1,5 %	1,3 %

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	20	93	526	318	4	103	566	556
Real	101	13	283	508	85	12	138	347	103	4	338	349
Total	115	115	973	973	105	105	665	665	107	107	905	905

* 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 28 de noviembre se presenta la proyección de vencimientos.