

Fecha de Publicación: 30 de Noviembre de 2005
Fecha de Información: 28 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\$294,5 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de $-0,4\%$.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero		Sector Real		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	71,4	68,2	6,9	10,1	78,3
15-35	67,0	34,9	20,9	53,0	87,9
36-60	10,3	39,1	33,8	5,0	44,1
61-90	13,0	18,5	7,5	2,0	20,5
91-180	54,5	6,3	6,2	54,4	60,7
>180	2,5	0,5	0,5	2,5	3,0
Total	218,8	167,4	75,7	127,1	294,5

* Cifras en millones de dólares

Cuadro No. 2
Devaluación Implícita Anualizada

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

Sectores	28 de Nov. al 2 de Diciembre				5 al 9 de Diciembre				12 al 16 de Diciembre			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Financiero	20	95	542	333	5	104	622	609	15	104	572	419
Real	87	12	143	352	103	4	340	353	103	15	338	491
Total	107	107	685	685	108	108	962	962	119	119	910	910

* 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 29 de noviembre se presenta la proyección de vencimientos.