

Fecha de Publicación: 1 de Diciembre de 2005
Fecha de Información: 29 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\$300,1 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de ,4%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero		Sector Real		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	53,4	59,4	10,4	4,4	63,8
15-35	64,2	57,0	11,0	18,2	75,2
36-60	67,1	44,0	7,0	30,1	74,1
61-90	9,1	31,5	26,5	4,1	35,6
91-180	30,6	9,3	4,3	25,6	34,8
>180	0,0	16,5	16,5	0,0	16,5
Total	224,5	217,6	75,6	82,5	300,1

* Cifras en millones de dólares

Cuadro No. 2
Devaluación Implícita Anualizada

Rango	Promedio Simple	Promedio Ponderado por Monto
3-14	-0,4 %	0,4 %
15-35	0,0 %	0,1 %
36-60	0,3 %	0,3 %
61-90	0,5 %	0,8 %
91-180	0,5 %	0,3 %
>180	1,5 %	1,3 %
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	546	337	5	104	657	642	15	104	605	467
Real	87	12	145	354	103	4	340	355	104	15	353	491
Total	107	107	691	691	108	108	997	997	119	119	958	958

* 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 30 de noviembre se presenta la proyección de vencimientos.