

Fecha de Publicación: 27 de Octubre de 2005
Fecha de Información: 25 de Octubre de 2005¹

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Según el reporte de los Intermediarios del Mercado Cambiario durante el día se pactó un total de US\$167,1 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	18,1	16,6	1,6	3,1	19,7
15-35	79,7	35,1	25,1	69,7	104,8
36-60	25,7	0,8	0,8	25,7	26,5
61-90	0,2	3,5	3,5	0,2	3,6
91-180	-	2,5	2,5	-	2,5
>180	10,0	5,1	0,1	5,0	10,1
Total	133,7	63,4	33,4	103,7	167,1

* Cifras en millones de dólares

Cuadro No. 2
Devaluación Implícita Anualizada

Rango	Promedio Simple	Promedio Ponderado por Monto
3-14	0,8 %	0,4 %
15-35	0,9 %	1,3 %
36-60	1,1 %	1,8 %
61-90	1,7 %	1,2 %
91-180	1,8 %	1,8 %
>180	2,3 %	2,1 %
Total	1,1 %	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	24 al 28 de Octubre				31 de Oct. al 4 de Noviembre				7 al 11 de Noviembre			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Financiero	18	102	623	537	14	142	413	237	3	98	413	391
Real	102	18	280	366	142	13	107	283	98	3	282	303
Total	120	120	903	903	155	155	520	520	101	101	695	695

* 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 26 de octubre se presenta la proyección de vencimientos.