

Fecha de Publicación: 28 de Octubre de 2005
Fecha de Información: 26 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\$266,8 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de 2,5%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero		Sector Real		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	44,9	47,0	6,0	3,9	50,9
15-35	68,2	150,9	124,9	42,2	193,0
36-60	6,1	5,5	0,5	1,1	6,6
61-90	1,5	1,4	1,4	1,5	2,9
91-180	11,0	1,8	1,8	11,0	12,9
>180	-	0,5	0,5	-	0,5
Total	131,7	207,1	135,1	59,7	266,8

* Cifras en millones de dólares

Cuadro No. 2
Devaluación Implícita Anualizada

Rango	Promedio Simple	Promedio Ponderado por Monto
3-14	2,9 %	2,9 %
15-35	1,3 %	2,5 %
36-60	1,1 %	1,6 %
61-90	1,2 %	1,2 %
91-180	1,6 %	1,5 %
>180	2,4 %	2,1 %
Total	1,6 %	2,5 %

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	103	623	536	15	142	437	261	5	98	431	429
Real	103	18	280	366	142	15	108	284	98	5	302	303
Total	120	120	903	903	157	157	545	545	103	103	733	733

* 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 27 de octubre se presenta la proyección de vencimientos.