

Fecha de Publicación: 31 de Octubre de 2005
Fecha de Información: 27 de Octubre 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\$247,9 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de 2,0%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero		Sector Real		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	38,0	18,3	5,3	25,0	43,2
15-35	78,6	132,6	87,1	33,1	165,7
36-60	10,9	9,0	9,0	10,9	19,9
61-90	7,2	1,4	1,4	7,2	8,5
91-180	1,4	3,5	2,1	-	3,5
>180	7,0	7,0	0,0	-	7,0
Total	143,1	171,8	104,8	76,2	247,9

* Cifras en millones de dólares

Cuadro No. 2
Devaluación Implícita Anualizada

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

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	537	22	142	452	268	7	98	446	452
Real	103	18	280	366	142	22	108	291	98	6	319	312
Total	121	121	903	903	164	164	559	559	105	105	765	765

* 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 octubre se presenta la proyección de vencimientos.