

Fecha de Publicación: 04 de Noviembre de 2005
Fecha de Información: 02 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\$212,4 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de ,7%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero		Sector Real		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	14,6	38,6	38,6	14,6	53,2
15-35	57,9	112,9	66,9	11,9	124,8
36-60	27,6	1,2	0,2	26,6	27,8
61-90	0,1	5,2	5,2	0,1	5,3
91-180	-	1,3	1,3	-	1,3
>180	-	0,0	0,0	-	0,0
Total	100,2	159,2	112,2	53,2	212,4

* Cifras en millones de dólares

Cuadro No. 2
Devaluación Implícita Anualizada

Rango	Promedio Simple	Promedio Ponderado por Monto
3-14	0,2 %	-0,7 %
15-35	1,0 %	1,3 %
36-60	0,5 %	0,3 %
61-90	1,8 %	1,7 %
91-180	1,6 %	1,0 %
>180	2,5 %	2,5 %
Total	0,9 %	0,7 %

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

Sector	31 de Oct. al 4 de Noviembre				7 al 11 de Noviembre				14 al 18 de Noviembre			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Financiero	25	144	486	305	11	101	464	483	16	83	586	420
Real	144	25	119	299	101	10	350	330	83	15	241	407
Total	169	169	605	605	112	112	813	813	98	98	827	827

* 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 3 de noviembre se presenta la proyección de vencimientos.