

Fecha de Publicación: 09 de Noviembre de 2005
Fecha de Información: 04 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\$108,5 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de 1,2%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero		Sector Real		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	30,1	17,9	12,9	25,1	43,1
15-35	22,4	25,9	19,9	16,4	42,3
36-60	8,1	0,5	0,5	8,1	8,6
61-90	6,6	5,1	3,7	5,1	10,3
91-180	0,1	1,3	1,3	0,1	1,3
>180	-	3,0	3,0	-	3,0
Total	67,2	53,8	41,4	54,7	108,5

* Cifras en millones de dólares

Cuadro No. 2
Devaluación Implícita Anualizada

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

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	26	111	486	321	10	101	472	486	24	84	605	465
Real	110	26	134	300	101	10	352	339	84	24	281	421
Total	136	136	621	621	111	111	825	825	107	107	886	886

* 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 7 de noviembre se presenta la proyección de vencimientos.