

Fecha de Publicación: 26 de Octubre de 2005
Fecha de Información: 24 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\$172,3 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de 1,0%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero		Sector Real		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	13,7	22,1	12,1	3,7	25,7
15-35	83,7	61,4	39,4	61,7	123,1
36-60	5,6	-	-	5,6	5,6
61-90	3,8	2,6	2,6	3,8	6,3
91-180	-	1,1	1,1	-	1,1
>180	10,0	0,4	0,4	10,0	10,4
Total	116,7	87,6	55,6	84,7	172,3

* Cifras en millones de dólares

Cuadro No. 2
Devaluación Implícita Anualizada

Rango	Promedio Simple	Promedio Ponderado por Monto
3-14	0,9 %	-0,5 %
15-35	1,1 %	1,1 %
36-60	1,0 %	1,2 %
61-90	1,7 %	1,5 %
91-180	4,0 %	11,0 %
>180	2,5 %	1,8 %
Total	1,5 %	1,0 %

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	102	622	536	12	142	398	222	3	99	400	381
Real	102	18	279	365	142	11	106	282	99	3	282	301
Total	120	120	901	901	153	153	504	504	102	102	682	682

* 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 25 de octubre se presenta la proyección de vencimientos.