

Fecha de Publicación: 02 de Noviembre de 2005

Fecha de Información: 31 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\$137,1 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de 1,6%.²

**Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados**

Rango	Sector Financiero		Sector Real		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	3,8	0,6	0,6	3,8	4,4
15-35	61,8	50,4	25,4	36,8	87,1
36-60	7,7	0,2	0,2	7,7	7,9
61-90	3,3	0,9	0,9	3,3	4,3
91-180	23,1	9,9	9,9	23,1	33,0
>180	0,2	0,3	0,3	0,2	0,5
Total	99,9	62,2	37,2	74,9	137,1

* Cifras en millones de dólares

**Cuadro No. 2
Devaluación Implícita Anualizada**

Rango	Promedio Simple	Promedio Ponderado por Monto
3-14	1,9 %	1,3 %
15-35	4,2 %	1,7 %
36-60	1,4 %	0,8 %
61-90	2,0 %	1,5 %
91-180	1,5 %	1,6 %
>180	1,9 %	2,0 %
Total	2,8 %	1,6 %

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	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	466	285	8	98	454	452	15	83	545	386
Real	143	24	119	299	98	8	319	320	83	15	235	394
Total	168	168	585	585	106	106	773	773	98	98	780	780

* 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 1 de noviembre se presenta la proyección de vencimientos.