

Fecha de Publicación: 03 de Noviembre de 2005
Fecha de Información: 01 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\$115,9 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de ,9%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero		Sector Real		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	20,2	20,6	0,6	0,2	20,8
15-35	42,9	57,7	30,7	15,9	73,6
36-60	4,7	0,6	0,6	4,7	5,3
61-90	-	0,6	0,6	-	0,6
91-180	10,0	13,6	5,6	2,0	15,6
>180	-	0,0	0,0	-	0,0
Total	77,8	93,1	38,1	22,8	115,9

* Cifras en millones de dólares

Cuadro No. 2
Devaluación Implícita Anualizada

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

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	8	98	454	453	15	83	568	398
Real	144	24	119	299	98	8	320	321	83	15	235	404
Total	168	168	605	605	106	106	774	774	98	98	803	803

* 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 2 de noviembre se presenta la proyección de vencimientos.