

Fecha de Publicación: 4 de Octubre de 2005
Fecha de Información: 30 de Septiembre 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\$211,7 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de ,5%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero		Sector Real		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	40,8	43,6	23,6	20,8	64,5
15-35	50,9	50,1	39,1	39,9	90,1
36-60	10,0	0,2	0,2	10,0	10,2
61-90	34,7	16,7	6,7	24,7	41,4
91-180	2,2	3,2	3,2	2,2	5,4
>180	0,1	0,1	0,1	0,1	0,2
Total	138,8	113,9	72,9	97,8	211,7

* Cifras en millones de dólares

Cuadro No. 2
Devaluación Implícita Anualizada

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

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	26 al 30 de Septiembre				3 al 7 de Octubre				10 al 14 de Octubre			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Financiero	6	77	677	586	14	83	750	438	16	158	421	277
Real	77	5	310	401	83	14	103	415	157	14	109	253
Total	82	82	987	987	97	97	853	853	172	172	531	531

* 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 3 de octubre se presenta la proyección de vencimientos.