

Fecha de Publicación: 5 de Octubre de 2005
Fecha de Información: 03 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\$300,4 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de ,4%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero		Sector Real		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	57,1	50,5	13,5	20,1	70,6
15-35	73,5	114,1	76,1	35,5	149,6
36-60	29,5	17,7	4,7	16,5	34,2
61-90	7,3	10,5	10,5	7,2	17,7
91-180	10,1	3,3	3,3	10,1	13,4
>180	10,9	4,0	4,0	10,9	14,9
Total	188,4	200,0	112,0	100,3	300,4

* Cifras en millones de dólares

Cuadro No. 2
Devaluación Implícita Anualizada

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

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	3 al 7 de Octubre				10 al 14 de Octubre				17 al 21 de Octubre			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Financiero	15	83	757	451	16	158	471	315	4	72	436	406
Real	83	15	116	422	157	14	110	266	72	4	263	293
Total	97	97	873	873	172	172	581	581	76	76	699	699

* Cifras en millones de dólares

¹ Datos provisionales.

² La fórmula para la devaluación implícita es: ((Tasa Pactada/Promedio SET FX) ^ (365/Plazo)) - 1

³ A partir del 4 de octubre se presenta la proyección de vencimientos.